

PROSPEKT

19 oktober 2026

Amundi Index Solutions

Ett luxemburgskt fondföretag

INNEHÅLL

NÅGRA ORD TILL POTENTIELLA INVESTERARE 7

BESKRIVNING AV DELFONDERNA 10

DELFONDERNA FÖRVALTAS PASSIVT 11

- Amundi FTSE EPRA NAREIT Global 11
- Amundi Core MSCI Emerging Markets 14
- Amundi Core MSCI Europe 17
- Amundi MSCI Japan ESG Broad Transition 20
- Amundi MSCI North America ESG Broad Transition 23
- AMUNDI INDEX MSCI WORLD 26
- Amundi CAC 40 ESG 29
- Amundi DJ Switzerland Titans 30 32
- Amundi Core DAX 35
- AMUNDI DIVDAX 38
- AMUNDI SDAX 41
- Amundi Core EURO STOXX 50 44
- Amundi Euro STOXX Select Dividend30 47
- AMUNDI F.A.Z. 100 50
- AMUNDI FTSE EPRA EUROPE REAL ESTATE 53
- AMUNDI ITALY MIB ESG 56
- AMUNDI JAPAN TOPIX 59
- AMUNDI JPX-NIKKEI 400 61
- Amundi MSCI China Tech 64
- Amundi Core MSCI China A Swap 67
- AMUNDI MSCI EM ASIA 70
- AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA 72
- Amundi MSCI Emerging Markets Swap 74
- Amundi MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad Transition 76
- Amundi MSCI Europe Growth 79
- Amundi MSCI Europe High Dividend Factor 82
- Amundi MSCI Europe Minimum Volatility Factor 85
- Amundi MSCI Europe Momentum Factor 88
- Amundi MSCI Europe Quality Factor 91
- Amundi MSCI Europe Value Factor 94
- Amundi MSCI India Swap II 97
- Amundi MSCI Nordic 99
- Amundi MSCI Switzerland 102
- Amundi PEA MSCI USA ESG Selection 104
- Amundi MSCI USA Minimum Volatility Factor 107
- Amundi MSCI World Swap 110
- Amundi Core MSCI World Swap 112
- Amundi Global Bioenergy 114
- Amundi MSCI World Ex Europe 117
- Amundi Nasdaq-100 Swap 119
- Amundi Gold Miners 121
- AMUNDI PEA DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE 124
- Amundi Russell 2000 127
- Amundi S&P 500 Swap 130
- Amundi S&P 500 Buyback 132
- Amundi Global Luxury 134
- Amundi Global Luxury 137
- Amundi MSCI Smart Cities 140
- Amundi Core Stoxx Europe 600 143
- Amundi MSCI Robotics & AI 146
- Amundi Prime Emerging Markets 149
- Amundi Prime Europe 152
- Amundi Prime Eurozone 155
- Amundi Prime Japan 158
- Amundi Prime UK MID And Small Cap 161
- Amundi Prime USA 164
- Amundi MSCI EM Asia SRI Climate Paris Aligned 167
- Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned 170
- Amundi MSCI EMU SRI Climate Paris Aligned 173
- Amundi MSCI Europe SRI Climate Paris Aligned 176
- Amundi MSCI Japan SRI Climate Paris Aligned 179
- Amundi MSCI Pacific Ex Japan SRI Climate Paris Aligned 182

Amundi MSCI USA SRI Climate Paris Aligned 185
Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned 188
Amundi MSCI UK IMI SRI Climate Paris Aligned 191
Amundi MSCI EMU Screened 194
Amundi MDAX ESG 197
Amundi S&P 500 Screened 200
Amundi STOXX Europe 600 ESG 203
Amundi MSCI AC Far East Ex Japan ESG Selection 206
Amundi MSCI Emerging Markets Screened 209
Amundi MSCI China ESG Selection 212
Amundi MSCI Emerging Ex China ESG Selection 215
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Selection 218
Amundi MSCI EMU ESG Selection 221
Amundi MSCI USA ESG Selection 224
Amundi MSCI Europe Climate Paris Aligned 227
Amundi MSCI World ESG Broad Transition 230
Amundi MSCI Europe ESG Broad Transition 233
Amundi MSCI EMU ESG Broad Transition 236
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Broad Transition 239
Amundi MSCI Europe Small Cap ESG Broad Transition 242
Amundi MSCI Pacific ESG Broad Transition 245
Amundi EUR Corporate Bond 0-1Y ESG 248
Amundi Global Aggregate Bond ESG 251
Amundi Global Aggregate Bond 1-5Y ESG 254
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG 257
Amundi EUR Corporate Bond ESG 260
Amundi Euro Aggregate Bond ESG 263
Amundi EUR Corporate Bond 0-3Y ESG 266
Amundi USD Corporate Bond ESG 269
Amundi Global Government Tilted Green Bond 272
Amundi MSCI EMU Climate Paris Aligned 275
Amundi China CNY Bonds 278
Amundi EUR Corporate Bond 1-5Y ESG 281
Amundi Core Global Aggregate Bond 284
Amundi Core Euro Government Bond 287
Amundi Core Global Government Bond 290
Amundi Euro High Yield Bond ESG 293
Amundi EUR Short Term High Yield Corporate Bond ESG 296
Amundi EUR Floating Rate Corporate Bond ESG 299
Amundi USD Floating Rate Corporate Bond ESG 302
Amundi Global High Yield Corporate Bond ESG 305
Amundi USD Emerging Markets Government Bond 308
Amundi Global Inflation-Linked Bond Select 311
Amundi Euro Government Bond 25+Y 314
Amundi Euro Government Tilted Green Bond 317
Amundi Euro Government Bond Highest Rated Investment Grade 320
Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond 323
Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond 1-3Y 326
Amundi Italy BTP Government Bond 1-3Y 329
Amundi Italy BTP Government Bond 10Y 332
Amundi Core EUR Corporate Bond 335
Amundi Prime Euro Government Bond 0-1Y 338
Amundi Prime Euro Government Bond 341
Amundi Prime Global Government Bond 344
Amundi Core USD Corporate Bond 347
Amundi Core US Treasury Bond 350

Amundi US Treasury Bond 0-1Y 353
Amundi Global Corporate IG.....356
Amundi FTSE EPRA NAREIT Global II ..359
Amundi MSCI EMU Small Cap ESG Broad Transition 361
Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30 364
Amundi USD Corporate Bond Climate Paris Aligned 367
Amundi USD High Yield Corporate Bond ESG 370
Amundi EUR High Yield Corporate Bond ESG 373
Amundi Fixed Maturity 2027 Italy BTP Government Bond.....376
Amundi Fixed Maturity 2027 German Bund Government Bond.....379
Amundi Fixed Maturity 2028 Euro Government Bond Broad 382
AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND YIELD + ...385
Amundi Fixed Maturity 2026 Euro Government Bond Broad 388
AMUNDI FIXED MATURITY 2027 EURO GOVERNMENT BOND BROAD.....391
AMUNDI FIXED MATURITY 2029 EURO GOVERNMENT BOND BROAD.....394
Amundi MSCI EM Asia ESG Broad Transition 397
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y Highest Rated ESG.....400
Amundi Lifecycle 2030.....403
AMUNDI LIFECYCLE 2033 406
Amundi Lifecycle 2036.....409
Amundi Lifecycle 2039.....412
Amundi Global Treasury Bond.....415
Amundi Global Corporate Bond 418
Amundi Euro Government Low Duration Tilted Green Bond 421
Amundi STOXX Europe Defense.....424
Amundi Singapore Straits Times 427
Amundi MSCI Europe Screened.....430
Amundi Core GBP Corporate Bond.....433
Amundi Fixed Maturity 2030 Euro Government Bond Broad 436
Amundi MSCI Global Small Cap OECD Ex USA.....439
Amundi Global ex-US Government Bond 442
Amundi Global Government Bond GDP-Weighted.....445
Amundi Euro Stoxx 50 Target Income.....448
Amundi Nasdaq-100 Target Income.....451
Amundi Euro Stoxx 454
Amundi Core MSCI USA Swap.....457
Amundi Core MSCI ACWI Swap.....459
Amundi US TIPS Ultrashort*.....462
Amundi MSCI Emerging Ex-China.....464
DELFONDERNA FÖRVALTAS AKTIVT 466
Amundi EUR Cash Active 466
Amundi USD Cash Active 469
HÅLLBAR INVESTERING.....472
RISKBESKRIVNINGAR.....476
ALLMÄN PLACERINGSINRIKTNING 485
KRAV PÅ DIVERSIFIERING.....487
HANTERING OCH ÖVERVAKNING AV GLOBAL RISKEXPONERING.....488
REPLIKERINGSMETODER FÖR PASSIVT FÖRVALTAD DELFOND.....489
FÖR PENNINGMARKNADSDELFONDER.492
ANVÄNDNING AV BLOCKKEDJOR.....498
MER OM DERIVAT OCH TEKNIKER 499
ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR 502
REGELVERK FÖR JÄMFÖRELSEINDEX..507
INVESTERA I DELFONDERNA.....515
SICAV-fonden.....526
FÖRVALTNINGSBOLAGET.....532
BILAGA 1 – ESG-RELATERADE UPPLYSNINGAR 534
AMUNDI CAC 40 ESG.....534

Amundi MSCI EMU Screened.....544
Amundi EUR Corporate Bond 0-1Y ESG 554
AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG.....564
AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG.....574
AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG 584
AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG 595
AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG.....606
AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG.....617
Amundi USD Corporate Bond Climate Paris Aligned 627
Amundi Global Government Tilted Green Bond 638
Amundi Stoxx Europe 600 ESG 646
Amundi S&P 500 Screened.....657
Amundi PEA MSCI USA ESG Selection 667
Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned 677
Amundi MSCI World ESG Broad Transition.....688
Amundi MSCI USA SRI Climate Paris Aligned 698
Amundi MSCI USA ESG Selection 708
Amundi MSCI UK IMI SRI Climate Paris Aligned 718
Amundi MSCI Smart Cities.....729
Amundi MSCI Robotics & AI 741
Amundi EUR Corporate Bond 0-3Y ESG 753
Amundi MSCI Pacific Ex Japan SRI Climate Paris Aligned 763
Amundi MSCI Pacific ESG Broad Transition.....774
Amundi MSCI North America ESG Broad Transition.....785
Amundi MSCI Japan SRI Climate Paris Aligned 795
Amundi MSCI Japan ESG Broad Transition.....806
Amundi MSCI Europe SRI Climate Paris Aligned 817
Amundi MSCI Europe Small Cap ESG Broad Transition 828
Amundi MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad Transition 839
Amundi MSCI Europe ESG Broad Transition.....849
Amundi MSCI Europe Climate Paris Aligned 859
Amundi MSCI EMU SRI Climate Paris Aligned 870
Amundi MSCI EMU Small Cap ESG Broad Transition.....881
Amundi MSCI EMU ESG Selection.....891
Amundi MSCI EMU ESG Broad Transition 901
Amundi MSCI EMU Climate Paris Aligned 911
Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned 922
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Broad Transition 933
Amundi MSCI Emerging Ex China ESG Selection.....943
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Selection.....953
Amundi MSCI EM Asia SRI Climate Paris Aligned 963
Amundi MSCI EM Asia ESG Broad Transition.....974
Amundi MSCI China Tech.....984
Amundi MSCI China ESG Selection 994
Amundi MSCI AC Far East Ex Japan ESG Selection.....1004
Amundi MSCI Emerging Markets Screened 1014
AMUNDI MDAX ESG 1024
AMUNDI LIFECYCLE 2039 1035
AMUNDI LIFECYCLE 2036.....1045
Amundi Lifecycle 2033 1055

AMUNDI LIFECYCLE 2030.....1065
AMUNDI ITALY MIB ESG 1075
Amundi USD Corporate Bond ESG....1084
Amundi EUR Corporate Bond ESG....1094
Amundi Euro Aggregate Bond ESG...1104
AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG.....1114
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y Highest Rated ESG.....1125
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG 1135
Amundi Global Bioenergy.....1145
Amundi Global Aggregate Bond 1-5Y ESG 1155
Amundi Global Aggregate Bond ESG 1165
AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG 1175
AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND 1186
AMUNDI EURO GOVERNMENT LOW DURATION TILTED GREEN BOND 1195
Amundi MSCI Europe Screened 1205
Amundi EUR Cash Active 1215
Amundi USD Cash Active 1225

NÅGRA ORD TILL POTENTIELLA INVESTERARE

ALLA INVESTERINGAR INNEBÄR RISK

Som med de flesta investeringar kan dessa delfonders framtida resultat skilja sig från tidigare resultat. Det finns ingen garanti för att någon delfond når sina mål eller uppnår någon särskild resultatnivå.

Investeringar i delfonden är inte bankinsättningar. Värdet på din investering kan öka och minska, och du kan förlora pengar. Ingen delfond i det här prospektet är avsedd som en fullständig investeringsplan, och alla delfonder är inte heller lämpliga för alla investerare.

Innan du investerar i en viss delfond bör du förstå riskerna, kostnaderna och investeringsvillkoren för delfonden. Du bör också förstå hur väl dessa egenskaper överensstämmer med dina egna ekonomiska omständigheter och din tolerans för investeringsrisk.

Som potentiell investerare är det ditt ansvar att känna till och följa de lagar och förordningar som gäller för dig och att vara medveten om de potentiella skattekonsekvenserna din investering kan medföra. Vi rekommenderar att varje investerare rådfrågar en investeringsrådgivare, en juridisk rådgivare och en skatterådgivare innan de investerar.

Observera att eventuella skillnader mellan valutor för portföljvärdepapper, valutor för andelsklasser och din lokala valuta utsätter dig för valutarisk. Om din lokala valuta dessutom skiljer sig från den valuta i vilken den andelsklass du äger rapporterar sitt resultat, kan det resultat du som investerare upplever skilja sig väsentligt från andelsklassens publicerade resultat.

VEM KAN INVESTERA I DESSA DELFONDER

Att distribuera detta prospekt, erbjuda dessa aktier till försäljning eller investera i dessa aktier är lagligt endast om aktierna är registrerade för offentlig försäljning eller om försäljning inte är förbjuden enligt lokala lagar och förordningar.

Detta prospekt är inte ett erbjudande eller en uppmaning i någon jurisdiktion, eller till någon investerare, om en sådan uppmaning inte är tillåten enligt lag.

Dessa aktier är inte registrerade hos US Securities and Exchange Commission eller någon annan amerikansk enhet, vare sig federal eller annan. Om SICAV-fonden inte är övertygad om att det inte skulle utgöra en överträdelse av amerikansk värdepapperslagstiftning, är dessa aktier inte tillgängliga för eller till förmån för amerikanska personer (”US persons”).

För mer information om begränsningar gällande aktieägande eller för att begära styrelsens godkännande för att investera i en begränsad klass (se avsnittet ”Policyer för andelsklasser”).

VILKEN INFORMATION SKA MAN FÖRLITA SIG PÅ?

Vid beslut om att investera i en delfond eller inte bör du titta på detta prospekt, relevant faktablad, ansökningsformuläret (i förekommande fall) och delfondens senaste årsrapport.

Dessa dokument måste alla distribueras tillsammans (och med eventuella senare halvårsrapporter, om de publicerats), och detta prospekt är inte giltigt utan de andra dokumenten. Genom att köpa andelar i någon av dessa delfonder anses du ha accepterat villkoren som beskrivs i dessa dokument.

Tillsammans innehåller alla dessa dokument den enda godkända informationen om delfonderna och SICAV-fonden. Styrelsen är inte ansvarig för några uttalanden eller någon information om delfonderna eller SICAV-fonden som inte finns i dessa dokument. Vid eventuell avvikelse i översättningarna av detta prospekt kommer den engelska versionen att gälla

TERMER MED SPECIFIKA BETYDELSER

Villkoren i denna ruta har följande betydelser i detta prospekt:
Ord och uttryck som definieras i 2010 års lag men inte här, har samma innebörd som i 2010 års lag.
2010 års lag: Den luxemburgska lagen av den 17 december 2010 om företag för kollektiva investeringar, i dess ändrade lydelse.
Bolagsordning Bolagsordningen för SICAV-fonden, i dess ändrade lydelse.

Aktivt förvaltade delfonder: styrelsen kan bilda delfonder som förvaltas aktivt av investeringsförvaltaren eller dess delegater för att sträva efter att uppnå ett specifikt investeringsmål, som kan inbegripa att överträffa ett jämförelseindex (”**aktivt förvaltade delfonder**”). En aktivt förvaltad delfonds investeringsmål är att ge en avkastning genom att investera direkt i investeringsinstrument i enlighet med det specifika investeringsmålet och placeringsinriktningen som anges i den aktuella delfondens beskrivning i enlighet med 2010 års lag och/eller förordningen om penningmarknadsfonder när det är tillämpligt enligt beskrivningen i avsnittet ”Allmän placeringsinriktning”. Om en delfond förvaltas aktivt kan investeringsförvaltaren och/eller underförvaltaren (beroende på vilket som är tillämpligt) efter eget gottfinnande sätta samman delfondens portfölj i enlighet med investeringsmålet och placeringsinriktningen som anges i delfondens beskrivning. De aktivt förvaltade delfonderna inbegriper penningmarknadsdelfonder enligt närmare beskrivning i avsnittet ”Allmän placeringsinriktning” i detta prospekt.

Auktoriserad aktör: en institutionell investerare, marknadsgarant eller mäklarenhet som godkänts av SICAV-fonden i syfte att direkt teckna och/eller lösa in UCITS ETF-andelar i en delfond hos SICAV-fonden.
Blockkedja: ett delat, oföränderligt och transparent digitalt register som registrerar transaktioner på ett säkert och decentraliserat sätt, en specifik typ av DLT.
Basvaluta: den valuta i vilken en delfond sköter bokföringen för sin portfölj och redovisar sitt primära substansvärde.
Styrelsen: styrelsen för SICAV-fonden.
Bankdag: varje veckodag annat än nyårsdagen, långfredagen, annandag påsk, 1 maj, juldagen och den 26 december (eller annan dag som styrelsen från tid till annan kan besluta om, med förbehåll för aktieägarmeddelande).
Kontantkomponent: kontantkomponenten i portföljsammansättningsfilen. Kontantkomponenten består av tre delar, nämligen: i) de upplupna utdelningar som kan hänföras till delfondens andelsägare (i allmänhet utdelningar och ränta som intjänats med avdrag för avgifter och kostnader som uppkommit sedan den föregående utdelningen), ii) kontantbelopp som representerar belopp som uppkommer till följd av avrundning nedåt av antalet andelar som ska levereras, kapital i kontanter som innehas av delfonden eller belopp som representerar skillnader mellan viktningen av portföljsammansättningsfilen och delfonden och iii) eventuella transaktionskostnader på primärmarknaden som kan behöva betalas.
Disclosureförordningen eller SFDR: Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn, så som den kan ändras, kompletteras, konsolideras eller ersättas vid olika tillfällen.
DLT: distribuerad databasteknik, är ett databassystem där data lagras i flera datorer istället för på en central plats. Denna decentraliserade struktur möjliggör en säker och transparent hantering av register.
Aktierelaterade instrument: värdepapper eller instrument som replikerar eller bygger på en aktie, inklusive en aktiewarrant, en teckningsrätt, en förvärvs- eller köprätt, ett inbäddat derivat baserat på aktier eller aktieindex och vars ekonomiska effekt leder till att uteslutande exponeras för aktier, ett depåbevis som ADR och GDR. Participatory Notes (P-Notes) är inbäddade derivat som inte omfattas av denna definition. Delfonder som avser att använda P-Notes kommer att ange det specifikt i sin placeringsinriktning.
Miljömässigt hållbara investeringar: en investering i en eller flera ekonomiska verksamheter som är miljömässigt hållbara enligt taxonomi-förordningen.

Miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet: för att fastställa i vilken grad en investering är miljömässigt hållbar skall en ekonomisk verksamhet anses miljömässigt hållbar om denna ekonomiska verksamhet väsentligt bidrar till ett eller flera av de miljömål som anges i taxonomiförordningen, inte nämnvärt skadar något av de miljömål som anges i taxonomiförordningen, genomförs i enlighet med de minimigarantier som fastställs i taxonomiförordningen samt uppfyller de tekniska screeningkriterier som har fastställts av EU-kommissionen i enlighet med taxonomiförordningen.
ESG: frågor gällande miljö, samhällsansvar och bolagsstyrning.
ESG-betygsatt: ett värdepapper med ESG-betyg eller som omfattas av ESG-utvärdering av Amundi Asset Management eller av en reglerad tredje part som är en erkänd leverantör av professionell ESG-betygsättning och utvärdering.
Europa: Danmark, Frankrike, Nederländerna, Storbritannien och deras respektive besittningar, Albanien, Andorra, Österrike, Belarus, Belgien, Bosnien och Hercegovina, Bulgarien, Kroatien, Cypern, Tjeckien, Estland, Finland, Tyskland, Grekland, Ungern, Island, Irland, Italien, Lettland, Liechtenstein, Litauen, Luxemburg, Nordmakedonien, Malta, Moldavien, Monaco, Montenegro, Norge, Polen, Portugal, Rumänien, Ryssland, San Marino, Serbien, Slovakien, Slovenien, Spanien, Sverige, Schweiz, Turkiet, Ukraina, Vatikanstaten, Europeiska unionen, Ryska federationen (OSS).
iNav: intradags substansvärde som gjorts tillgängligt av SICAV-fonden eller andra utsedda personer för SICAV-fondens räkning, för en eller flera aktier/delfonder noterade som ETF.
Delfonder som följer index eller passivt förvaltade delfonder: Styrelsen kan bilda delfonder som strävar efter att följa eller replikera resultatet för ett visst index (eller flera index) eller en viss strategi enligt närmare beskrivning i avsnittet ”Replikeringsmetoder för passivt förvaltade delfonder”.
Institutionella investerare: investerare som kvalificerar sig som institutionella investerare enligt artikel 175 i 2010 års lag och enligt CSSF:s riktlinjer eller rekommendationer.
Investeringar: överlåtbara värdepapper och alla andra likvida finansiella tillgångar som anges i avsnittet Allmän placeringsinriktning.
Insolvenshändelse: en händelse som inträffar för en person där i) en order har gjorts eller ett beslut har godkänts för likvidation eller konkurs för personen, ii) en mottagare eller liknande tjänsteman har utsetts för personen eller någon av personens tillgångar eller personen blir föremål för ett förvaltningsbeslut, iii) personen ingår i ett arrangemang med en eller flera av sina fordringsägare eller anses inte kunna betala sina skulder, iv) personen upphör eller hotar att upphöra att bedriva sin verksamhet eller i stort sett hela sin verksamhet eller gör eller hotar att göra några väsentliga ändringar av verksamhetens art, v) en händelse inträffar för personen i en jurisdiktion som har en liknande effekt som någon av de händelser som anges i iv) ovan eller vi) företaget i god tro anser att något av ovanstående kan inträffa.
Kreditvärdighet: klassificerad med minst BBB- av S&P, Baa3 av Moody's och/eller BBB- (av Fitch).
Faktablad: faktablad och/eller faktablad med basfakta för investerare
Latinamerika: Argentina, Bolivia, Brasilien, Chile, Colombia, Costa Rica, Kuba, Dominikanska republiken, El Salvador, Ecuador, Guatemala, Haiti, Honduras, Mexiko, Nicaragua, Panama, Paraguay, Peru, Uruguay, Venezuela.
Medlemsstat: en stat som är medlem i EU eller i Europeiska ekonomiska samarbetsområdet.
MENA (Mellanöstern och Nordafrika): Bahrain, Egypten, Jordanien, Kuwait, Libanon, Marocko, Oman, Qatar, Saudiarabien, Tunisien och Förenade Arabemiraten.
Penningmarknadsfond: penningmarknadsdelfond som investerar i instrument som endast är godtagbara enligt vad som avses i förordningen om penningmarknadsfonder. Förordningen om penningmarknadsfonder avser Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1131 av den 14 juni 2017 om penningmarknadsfonder.
Penningmarknadsdelfond: en delfond i SICAV-fonden som kvalificerar sig och är auktoriserad som en penningmarknadsfond enligt artikel 1 i förordningen om penningmarknadsfonder.
Substansvärde: Substansvärde. En andels värde.
Portföljsammansättningsfil: den fil som anger de investeringar och/eller den kontantkomponent som kan levereras av a) auktoriserade deltagare vid teckning eller b) SICAV-fonden vid inlösen.
Transparenskrav i portföljen för aktivt förvaltade delfonder: Portföljinnehav för de aktuella delfonderna publiceras dagligen med en dags fördröjning och finns via Amundis ETF-webbplats.
Prospekt: detta dokument, med ändringar från tid till annan.
Tekniska standarder för tillsyn: en konsoliderad uppsättning tekniska standarder som definierades av Europaparlamentet och rådet och offentliggjordes den 6 april 2022, som ger ytterligare information om innehållet, metoden och presentationen av vissa befintliga upplysningar.
SICAV-fonden: Amundi Index Solutions, en SICAV-fond med säte i Luxemburg.
SFT: transaktioner för värdepappersfinansiering (Securities Financing Transactions) enligt definitionen i Europaparlamentets och Europeiska rådets förordning (EU) 2015/2365 av den 25 november 2015 om insyn i transaktioner för värdepappersfinansiering och återanvändning (SFTR).
Finansiella rapporter till andelsägare: SICAV-fondens årsredovisningar och halvårsrapporter.
Hållbarhetsfaktorer: enligt artikel 2.24 i SFDR avser miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.
Hållbar investering: enligt artikel 2.17 i SFDR avser (1) en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål, i enlighet med vad som mäts genom centrala resurseffektivitetsindikatorer avseende (i) användning av energi, (ii) förnybar energi, (iii) råvaror, (iv) vatten och mark, (v) generering av avfall, (vi) utsläpp av växthusgaser eller (vii) avseende effekter på den biologiska mångfalden och den cirkulära ekonomin, eller (2) en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett socialt mål (i synnerhet investeringar som bidrar till att bekämpa ojämlikheter eller som främjar social sammanhållning, social integration och ett gott förhållande mellan arbetsmarknadens parter), eller (3) en investering i humankapital eller ekonomiskt eller socialt missgynnade grupper, förutsatt att investeringarna inte orsakar betydande skada för något av dessa mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning, särskilt med avseende på sunda förvaltningsstrukturer, relationer till arbetstagarna, löner till berörd personal och efterlevnad av skatteregler.
Information om Amundis metod för att bedöma om en investering anses vara en hållbar investering finns i Amundis ESG Regulatory Statement på amundi.com.
Hållbarhetsrisker: enligt artikel 2.22 i SFDR avser en miljörelaterad, social eller styrningsrelaterad händelse eller omständighet som, om den skulle inträffa, skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på investeringens värde. Risker relaterade till miljöfrågor inkluderar, men är inte begränsade till, klimatrisker, både fysiska risker och omställningsrisker. Fysisk risk uppstår från de fysiska effekterna av klimatförändringar, akuta eller kroniska. Exempelvis kan ofta förekommande och svåra klimatrelaterade händelser ha en negativ inverkan på produkter, tjänster och leverantörskedjor. Omställningsrisk kan uppstå oavsett om policy, teknik, marknad eller rykte förändras genom omställning till en ekonomi med låga koldioxidutsläpp för att mildra klimatförändringarna.
Risker relaterade till sociala frågor kan omfatta men är inte begränsade till mänskliga rättigheter, hälsa och säkerhet, ojämlikhet, integration och arbetsrättigheter.
Risker relaterade till bolagsstyrning kan omfatta men är inte begränsade till risker kring betydande och återkommande överträdelser av internationella avtal, korruption, styrelsens oberoende, ägarstruktur och kontroll, eller revision och skattehantering.
Dessa risker kan påverka en emittents operativa effektivitet och motståndskraft samt hur den allmänt uppfattas och dess rykte, vilket kan påverka dess lönsamhet och i sin tur dess kapitaltillväxt, och i slutänden påverkar värdet av komponenterna i det index som följs av delfonden.
Taxonomiförordningen: Europaparlamentets och Europeiska rådets förordning nr 2020/852 av den 27 november 2019 om upprättande av ett ramverk för att underlätta hållbara investeringar och om ändring av förordning (EU) 2019/2088 ”Förordningen om hållbarhetsupplysningar” (”SFDR”).
Aktiv risk: ett mått på volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och

indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med den aktiva risk som anges i bilagan för den aktuella delfonden. Den avkastning som används för att beräkna delfondens aktiva risk fastställs innan hänsyn tas till (i) eventuella swingprissättningsmekanismer eller (ii) eventuella säkringsinstrument som används för säkrade andelsklasser.

Transaktionskostnader: alla kostnader och utgifter som uppstår i samband med köp och försäljning av portföljens värdepapper och finansiella instrument, mäklararvoden och provisioner, ränta eller skatter som ska betalas på sådana köp- och försäljningstransaktioner.

Transaktionsdag: en bankdag då mottagna och godkända begäran om teckning, inlösen eller konvertering kan behandlas av registratorn som agerar på uppdrag av SICAV.

Varje bankdag är en transaktionsdag, dock kan bankdagar, efter fastställande av investeringsförvaltaren, inte vara transaktionsdagar när marknader där delfondens investeringar är noterade eller handlas, eller marknader som är relevanta för indexet är stängda och till följd detta en betydande del av indexet inte kan handlas.

De dagar som inte är transaktionsdagar för innevarande år finns tillgängliga på www.amundi.lu.

Styrelsen kan från tid till annan besluta att sådana andra dagar ska vara transaktionsdagar efter anmälan till samtliga andelsägare.

TRS: Totalavkastningsswappar.

Amerikansk person (US person): något av följande:

- en person som är bosatt i USA, en stiftelse som har en person bosatt i USA som förvaltare eller en egendom som en person bosatt i USA är exekutor eller förvaltare för
- ett partnerskap eller företag som bildats enligt amerikansk federal eller delstatlig lag
- ett ombud för eller en filial till en utländsk enhet som är belägen i USA
- ett icke-diskretionärt eller liknande konto (annat än ett fastighets- eller förvaltningskonto) som innehas av en återförsäljare eller annan förvaltare som är någon av ovanstående eller till förmån för någon av ovanstående eller nedanstående eller för deras räkning
- ett partnerskap eller företag som har bildats eller registrerats av någon av ovanstående enligt icke-amerikansk lagstiftning främst för att investera i värdepapper som inte är registrerade enligt 1933 års lag, såvida det inte har bildats och ägs av ackrediterade investerare som inte är fysiska personer, egendomar eller stiftelser.

Person med skatterättslig hemvist i USA (US tax resident): något av följande:

- amerikansk medborgare eller person bosatt i USA eller en sådan persons egendom
- ett partnerskap eller företag som bildats i USA eller enligt amerikansk federal eller delstatlig lag
- en stiftelse som kontrolleras i väsentlig grad av någon av ovanstående och i väsentlig grad befinner sig inom en amerikansk domstols jurisdiktion.

Vi, oss: SICAV-fonden agerar genom styrelsen eller genom någon tjänsteleverantör som beskrivs i detta prospekt med undantag för revisor och eventuella distributörer.

Du: tidigare, nuvarande eller blivande andelsägare, eller ett ombud för densamma.

BESKRIVNING AV DELFONDERNA

Introduktion till delfonderna

Alla delfonder som beskrivs här är en del av AMUNDI INDEX SOLUTIONS, en SICAV-fond som fungerar som en paraplystruktur. SICAV-fonden finns för att erbjuda investerare en rad delfonder med olika mål och strategier, och för att hantera tillgångarna i dessa delfonder till förmån för investerare.

För varje delfond beskrivs i detta avsnitt de specifika investeringsmålen och de viktigaste värdepappren som den kan investera i, tillsammans med andra nyckelegenskaper. Dessutom omfattas alla delfonder av den allmänna placeringsinriktning och de placeringsrestriktioner som beskrivs i avsnittet ”Allmän placeringsinriktning”.

Styrelsen för SICAV-fonden har det övergripande ansvaret för SICAV-fondens affärsverksamhet och dess investeringsverksamhet, inklusive investeringsverksamheten för samtliga delfonder.

Styrelsen har delegerat den dagliga förvaltningen av delfonderna till förvaltningsbolaget, som i sin tur har delegerat en del av sitt ansvar till ett antal investeringsförvaltare och andra tjänsteleverantörer.

Styrelsen behåller tillsynsmyndighetens godkännande och kontroll över förvaltningsbolaget.

Mer information om SICAV-fonden, styrelsen, förvaltningsbolaget och tjänsteleverantörerna i avsnitten ”SICAV-fonden” och ”Förvaltningsbolaget”.

För information om avgifter och kostnader som du kan behöva betala i samband med din investering, se följande:

- Högsta avgifter för köp, byte och inlösen av andelar: detta avsnitt (huvudklasser) och avsnittet ”Investera i delfonderna” (alla klasser).
- Högsta årliga avgifter som dras från din investering: detta avsnitt och avsnittet ”Andelsklasser”.

Senaste faktiska kostnader: tillämpligt faktablad (KID) eller SICAV-fondens senaste finansiella rapport till andelsägarna.

Avgifter för valutaomvandling, banktransaktioner och investeringsrådgivning: din finansiella rådgivare, överföringsombud (avsnitt ”SICAV-fonden”) eller andra tjänsteleverantörer, i tillämpliga fall.

Valutaförkortningar

AUD	Australisk dollar	**MXN**	Mexikansk peso
CAD	Kanadensisk dollar	**NOK**	Norsk krona
CHF	Schweizisk franc	**NZD**	Nyzeeländsk dollar
CZK	Tjeckisk krona	**PLN**	Polsk zloty
DKK	Dansk krona	**RMB**	Kinesisk renminbi
EUR	Euro	**RON**	Rumänsk leu
GBP	Brittiskt pund	**SEK**	Svensk krona
HKD	Hongkongdollar	**SGB**	Singaporiansk dollar
HUF	Ungersk forint	**THB**	Thailändsk baht
JPY	Japansk yen	**USD**	US-dollar

DELFONDERNA FÖRVALTAS PASSIVT

Amundi FTSE EPRA NAREIT Global[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för FTSE EPRA/NAREIT Developed Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex som är representativt för börsnoterade fastighetsföretag och fastighetsfonder i hela världen.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.
EPRA står för European Public Real Estate Association och NAREIT National Association of Real Estate Investment Trust.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Alla aktier i indexet viktas enligt storleken på deras justerade fritt flytande börsvärde.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:

- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: TRNGLE

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

(1) Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Fastighetsinvesteringar
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,19 %
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,14 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,14 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Core MSCI Emerging Markets

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI Emerging Markets Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i 23 tillväxtländer.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta: US-dollar

Indexets sammansättning

Alla aktier i indexet viktas enligt storleken på deras justerade fritt flytande börsvärde.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

–de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

–WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGF
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen: Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Tillväxtmarknader	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Landrisk – Kina	Derivat
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och

söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde: Byta in/ut **Transaktionsdag** D+1 tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,30 %	0,15 %
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF USD DIST	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF DR- USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.
TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Core MSCI Europe

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI Europe Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i 15 industriländer i Europa.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Alla aktier i indexet viktas enligt storleken på deras justerade fritt flytande börsvärde.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

–de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

–WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M7EU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:

Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”Transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1**
	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	1 USD	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,15 %
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEXEN UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Japan ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index (”**indexet**”) och minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Japan Index (”**moderindexet**”), som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag på den japanska marknaden. Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning (CTB) finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Japansk yen

Indexets sammansättning

Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

–de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

–WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXJPEGSL
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: JPY

Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad

Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde: Byta in/ut	**Transaktionsdag 1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	+1 USD	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,15 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,35 %	0,10 %
UCITS ETF - HEDGED EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	JPY	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF GBP Dist	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI North America ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI North America ESG Broad CTB Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI North America Index (”**moderindexet**”), som är representativt för segmenten med stora och medelstora företag på marknaderna i USA och Kanada och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

US-dollar.

Indexets sammansättning

MSCI North America ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

–de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

–WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXNAEBSL
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:

Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk

1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: USD

Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Derivat
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,15 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

AMUNDI INDEX MSCI WORLD

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI World Index(”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i 23 industriländer.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Alla aktier i indexet viktas enligt storleken på deras justerade fritt flytande börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

–de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

–WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDDUWI
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: USD

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Operativ	Likviditet
Motpart	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”Transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14. 00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1**
	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AU	USD	–	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,15 %
IU	USD	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi CAC 40 ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för CAC 40 ESG+ Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på CAC 40 Index som representerar de 40 största aktierna som handlas mest aktivt på Parisbörsen (”moderindexet”). Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på kriterier för miljö, socialt ansvar eller bolagsstyrning och strävar efter en minsta minskning av koldioxidintensiteten på 30 % i förhållande till moderindexet, ett förbättrat ESG-betyg och en bättre kvot mellan gröna och bruna företag, allt jämfört med moderindexet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet består av de företag som ingår i moderindexet. Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av uteslutningar och en optimeringsprocess för att minska koldioxidintensiteten, öka ESG-betyget och förbättra kvoten mellan gröna och bruna företag, allt jämfört med moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Euronext.
Indexet beräknas av Euronext med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: CACESGNR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Euronext-indexet finns på www.euronext.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 65 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.
Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	

Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Förvaltning	Hållbara investeringar

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Euronext N.V. och dess dotterbolag sponsrar inte, stödjer inte eller har någon annan inblandning i utgivningen och erbjudandet av produkten. Euronext N.V. och dess dotterbolag frånsäger sig allt ansvar för eventuella felaktigheter i de uppgifter som indexet baseras på, för eventuella misstag, fel eller utelämnanden i beräkningen eller spridningen av indexet, eller för det sätt på vilket det tillämpas i samband med emissionen och erbjudandet därav.

Euronext N.V. eller dess dotterbolag äger alla immateriella och andra rättigheter till indexet, inklusive namn, sammansättning och beräkning av indexet. Information om varumärken och immateriella rättigheter för Euronext finns på https://www.euronext.com/terms-use.

Amundi DJ Switzerland Titans 30

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Dow Jones Switzerland Titans 30 Total Return Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas på den schweiziska marknaden. Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
CHF

Indexets sammansättning
Indexet består av de 30 ledande företagen i Schweiz. Aktier väljs baserat på rangordningar av justerat fritt omsättningsbart börsvärde och genomsnittlig handelsvolym. Indexet viktas i enlighet med principerna för fritt omsättningsbart börsvärde, med en övre viktningsgräns på 10 % i förhållande till varje aktie.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Standard & Poor's (”**S&P**”).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: DJCH30TR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på www.eu.spindices.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 51 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: CHF

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond	Volatilitet
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standardmetoder
Operativ	Likviditet

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	CHF	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG (”**S&P**”). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS INDEXET ATT FÖLJA RESULTATET FÖR VISSA FINANSIELLA MARKNADER OCH/ELLER DELAR DÄRAV OCH/ELLER GRUPPER AV TILLGÅNGAR ELLER TILLGÅNGSKLASSER. S&P:S ENDA RELATION MELLAN S&P OCH AMUNDI ÄR LICENSIERING AV VISSA VARUMÄRKEN OCH HANDELSNAMN OCH INDEXET, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV S&P UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DELFONDEN. S&P HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL AMUNDIS ELLER INVESTERARNAS BEHOV NÄR INDEXET FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLANDET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNA OMVANDLAS TILL KONTANTER. S&P HAR INGA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER HANDEL MED DELFONDEN.

S&P GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN HOS INDEXET ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÄSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Core DAX

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för DAX INDEX (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas på den tyska marknaden. Indexet består av de 40 företag som har högst marknadsvärde på Frankfurtbörsen.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet är ett kapitalviktat index, där vikten på varje enskild emission står i proportion till dess respektive andel av den totala kapitaliseringen av indexet. Dock beaktas endast fritt tillgängliga och omsättningsbara aktier (fritt omsättningsbara). Viktningen i indexet baseras uteslutande på den fritt omsättningsbara delen av det emitterade aktiekapitalet.

Antalet aktier i enskilda företag kan begränsas för indexet så att en begränsad vikt av sådana företag inom indexet kan uppnås.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: DAX
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Marknad
Aktieexponering	Volatilitet
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond Förvaltning	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Derivat

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standardmetoder
Operativ	Likviditet

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0 030 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

AMUNDI DIVDAX

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för DivDAX Total Return Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som representerar 20 stora och medelstora tyska företag som ingår i det tyska DAX-jämförelseindexet och har den högsta direktavkastningen. Direktavkastningen beräknas genom att dividera utdelningar med stängningskursen för respektive aktie den dag som föregår den dagen.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet omfattar de 20 företag i det tyska DAX-jämförelseindexet som har den högsta direktavkastningen. Indexet viktas i enlighet med principerna för fritt omsättningsbart börsvärde, med en övre viktningsgräns på 10 % i förhållande till varje aktie.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: DIVDAX
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Marknad
Aktieexponering	Volatilitet
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond Förvaltning	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

AMUNDI SDAX

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för SDAX Total Return Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som representerar värdepapper för medelstora och små företag på den tyska marknaden.
Indexet är ett totalavkastningsindex: utdelningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
EUR

Indexets sammansättning
Indexet är urvalsindex för 70 mindre företag (små företag) som följer de företag som ingår i MDAX-indexet i termer av börsvärde och orderingång.

För att tas med i indexet beaktas endast de företag som är noterade på någon reglerad marknad och har en omsättningsbar andel på minst 10 %. Dessutom måste företagen antingen ha huvudkontor i Tyskland eller, om de har en stor andel av börsomsättningen i Tyskland, i Europeiska unionen eller i en EFTA-stat.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SDYP
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Marknad
Aktieexponering	Aktier i små och medelstora företag Volatilitet
Indexreplikering	
Investeringsfond Förvaltning	Hållbarhet
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Byta in/ut**
Transaktionsdag +1	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,60 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi Core EURO STOXX 50

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för EURO STOXX 50 Index (”**Indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för de 50 ledande aktierna i industriländer som också är medlemmar i euroområdet (enligt definitionen i indexmetoden).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
EUR

Indexets sammansättning
Indexet omfattar aktier som täcker alla ekonomiska sektorer och som väljs för sin börsvärdesnivå, sin likviditet och viktningen i sin sektor.

Alla aktier i indexet viktas enligt storleken på deras justerade fritt flytande börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SX5T
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 65 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1**
	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF EUR Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF USD Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi Euro STOXX Select Dividend30

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som representerar de aktier som ger högst avkastning i förhållande till sin hemmamarknad i länder i euroområdet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
EUR

Indexets sammansättning

Indexets komponenter väljs bland komponenterna i EURO STOXX och deras sekundära områden. Indexets investeringsområde omfattar alla företag i EURO STOXX Index som bland annat ger utdelning och visar en icke-negativ historisk utdelningstillväxt per andel under 5-årsperioden samt ett icke-negativt utdelningsförhållande (förhållandet mellan utdelningen och vinsten per andel) som inte är större än 60 %. EURO STOXX Index består av de största aktierna i utvalda länder i euroområdet och ingår i STOXX 600 Index. Komponenterna i indexet viktas efter indikerad årlig nettoutdelningsavkastning.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SD3T
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1**
	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

AMUNDI F.A.Z. 100

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för F.A.Z Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag på den tyska marknaden.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: FAZINTR

Det resultat som följs är stängningskursen för F.A.Z Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Marknad
Aktier	Volatilitet
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Förvaltning	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1**
	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

AMUNDI FTSE EPRA EUROPE REAL ESTATE

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för FTSE EPRA/NAREIT Developed Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande noterade fastighetsaktier och REIT som handlas på de stora aktiemarknaderna i industriländer i Europa (enligt definitionen i indexmetoden).
EPRA står för European Public Real Estate Association och NAREIT National Association of Real Estate Investment Trust.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
EUR

Indexets sammansättning
Indexet är en underkategori till FTSE EPRA/NAREIT Developed Index.

Det inledande företagsområdet för investeringar består av företag med följande klassificeringar enligt ICB: Supersector Real Estate, Subsector Heavy Construction och Subsector Home Construction.

Det inledande investeringsområdet kan av FTSE Russell utökas med andra företag som klassificerats enligt Industry Classification Benchmark (ICB), med vägledning från EPRA, NAREIT och den regionala rådgivande nämnden.
Relevanta fastighetsrelaterade aktiviteter definieras som ägande, handel och utveckling av fastigheter som genererar inkomster.

Fastighetsbolag måste under föregående räkenskapsår ha fått minst 75 % av sin totala EBITDA från relevanta fastighetsrelaterade aktiviteter.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: NEPRA

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktier	Fastighetsinvesteringar
Indexreplikering	Aktier i små och medelstora
Investeringsfond	företag Hållbarhet
Indirekt replikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	Transaktionsdag +1
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,20 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

AMUNDI ITALY MIB ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MIB ESG Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på de 40 mest likvida italienska aktierna med högst börsvärde som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV (det ”**godtagbara investeringsområdet**”).
Indexet utesluter företag från det godtagbara investeringsområdet baserat på kriterier för miljö, socialt ansvar eller bolagsstyrning och strävar efter en minsta minskning av koldioxidintensiteten på 30 % i förhållande till investeringsområdet och ett förbättrat ESG-betyg jämfört med beståndsdelarna i det godtagbara investeringsområdet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.
Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av uteslutningar och en optimeringsprocess för att minska koldioxidintensiteten och öka ESG-betyget, allt jämfört med det godtagbara investeringsområdet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Euronext.
Indexet beräknas av FTSE med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MIBESGNR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Euronext-indexet finns på www.euronext.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.
Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbar investering
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Euronext N.V. och dess dotterbolag sponsrar inte, stödjer inte eller har någon annan inblandning i utgivningen och erbjudandet av produkten.

Euronext N.V. och dess dotterbolag frånsäger sig allt ansvar för eventuella felaktigheter i de uppgifter som indexet baseras på, för eventuella misstag, fel eller utelämnanden i beräkningen eller spridningen av indexet, eller för det sätt på vilket det tillämpas i samband med emissionen och erbjudandet därav.

Euronext N.V. eller dess dotterbolag äger alla immateriella och andra rättigheter till indexet, inklusive namn, sammansättning och beräkning av indexet. Information om varumärken och immateriella rättigheter för Euronext finns på https://www.euronext.com/terms-use.

AMUNDI JAPAN TOPIX

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för TOPIX Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas i Japan.
Indexet är ett totalavkastningsindex: utdelningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
JPY

Indexets sammansättning

Indexet omfattar alla japanska aktier som är noterade i ”Section One” på Tokyo Stock Exchange och viktar företagen enligt deras justerade fritt omsättningsbara börsvärde.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Topix.
TOPIX Index beräknas av S&P med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.
Värdet för TOPIX Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: TPXDDVD
Det resultat som följs är stängningskursen för TOPIX Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Topix-indexet finns på www.jpx.co.jp.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap.
Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indirekt replikering
Derivat	Investeringsfond
Aktieexponering	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
	Hållbarhet
Indexreplikering	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF - JPY	JPY	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,38 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,38 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED GBP	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,38 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED CHF	CHF	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,38 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN ÄR INTE SPONSRAD, GODKÄND, DISTRIBUERAD ELLER MARKNADSFÖRD AV TOKYO STOCK EXCHANGE, INC (INDEXLEVERANTÖRER). Indexleverantören uttalar sig inte om huruvida en investering är lämplig. En fullständig beskrivning av indexen finns tillgänglig hos Tokyo Stock Exchange, Inc (/leverantörerna).

AMUNDI JPX-NIKKEI 400

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för JPX-Nikkei 400 Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för japanska aktier noterade på de första två sektionerna av Tokyobörsen samt på ”modersektionen” och JASDAQ-marknader.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
JPY

Indexets sammansättning
JPX-Nikkei 400 Index innehåller aktier som rankas baserat på kvantitativa kriterier (avkastning på eget kapital under de senaste tre åren utgör 40 %, rörelseresultat under de senaste tre åren utgör 40 %, börsvärde utgör 20 %) och kvalitativa kriterier relaterade till bolagsstyrning (oberoende styrelseledamöter i styrelsen, antagande av IFRS redovisningsstandarder, publicering av information på engelska). Kvalitativa och kvantitativa kriterier har samma viktning.

De 400 värdepapper som har högst totalt kreditbetyg ingår i indexet.

Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske årsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Nikkei.
Indexet beräknas av JPX-gruppen och Nikkei med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: JPNKNTR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Nikkei-indexet finns på www.jpx.co.jp.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: EUR

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indirekt replikering
Derivat	Investeringsfond
Aktieexponering	Förvaltning
Indexreplikering	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Operativ	Likviditet
Motpart	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1**
	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF - JPY	JPY	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED GBP	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED CHF	CHF	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Indexet och JPX-Nikkei Index 400 Total Return Index (eller JPX-Nikkei Index 400 Net Total Return Index) (hädanefter gemensamt kallat ”**indexet**”) är upphovsrättsskyddat material som beräknas med hjälp av en metod som självständigt utvecklats och skapats av Japan Exchange Group, Inc. och Tokyo Stock Exchange, Inc. (hädanefter gemensamt kallat ”**JPX Group**”) och Nikkei Inc. (hädanefter kallat ”**Nikkei**”), och JPX Group och Nikkei äger gemensamt upphovsrätten och andra immateriella rättigheter som finns i själva indexet och den metod som används för att beräkna indexet.
Äganderätten till varumärken och andra immateriella rättigheter avseende varumärken som representerar index tillhör JPX Group och Nikkei.

JPX Group och Nikkei sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden. JPX Group och Nikkei har, förutom att licensiera till Amundi Asset Management användningen av vissa varumärken och användningen av indexet för delfonden, ingen koppling till delfonden. Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och både JPX Group och Nikkei ger inga rättigheter till någon tredje part.

Delfonden bär hela risken för förvaltningen av AMUNDI JPX-NIKKEI 400 och varken JPX Group eller Nikkei har någon skyldighet eller ansvar för dess förvaltning och eller för de transaktioner som sker för delfonden. JPX Group och Nikkei ansvarar inte för riktigheten och beräkningen av AMUNDI ETF

JPX Group och Nikkei har ingen skyldighet att publicera indexet kontinuerligt och ska inte hållas ansvariga för eventuella fel, uppskjutanden, avbrott, avstängningar och upphöranden av publiceringen av JPX-Nikkei Index 400.

JPX Group och Nikkei har rätt att i framtiden göra eventuella ändringar i indexet avseende val av ingående aktier och beräkningsmetoder. JPX Group och Nikkei har rätt att avbryta eller upphöra med publiceringen av indexet utan förpliktelse gentemot Amundi Asset Management eller annan tredje part.

Amundi MSCI China Tech

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect Filtered Index (**"indexet**") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet strävar efter att representera resultatet för företag som är förknippade med utvecklingen av nya produkter och tjänster från tekniska innovationer som leder till genombrott inom områden som internet och digitalisering, mobilitet, autonom teknik, industriell automatisering och digital hälso- och sjukvård samtidigt som det utesluter företag som är involverade i vissa kontroversiella affärsverksamheter eller har relativt låga MSCI ESG-kontroversbetyg eller MSCI ESG-betyg.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexets godtagbara investeringsområde konstrueras genom att välja alla värdepapper från MSCI China Investable Market Index (IMI) (**överordnat index**) som har ett relevansbetyg på 25 % eller mer. För att fastställa det godtagbara investeringsområdet tillämpas ytterligare filtrering enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI ("**MSCI**").

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXCTIAEF
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om "hållbara investeringar" i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "replikeringsmetoder".

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten "Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering" och "Replikeringsmetoder" i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Tillväxtmarknader	Aktier i små och
Aktieexponering	medelstora företag
Indexreplikering	Volatilitet
Investeringsfond	Användning av tekniker
Landrisk – Kina	och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde Byta in/ut	**Transaktionsdag** +1 Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,45 %	0,10 %
UCITS ETF - USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,45 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Core MSCI China A Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI China A Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett index viktat efter fritt omsättningsbart börsvärde som är representativt för exponering mot resultatet för A-aktier i medelstora och stora företag. A-aktier är aktier i företag som är bildade i Folkrepubliken Kina, utom Hongkong och Macao, (Kina) och som handlas på Shanghai- och Shenzhenbörsen och är noterade i kinesiska yuan (CNY). Jämförelseindexet är representativt för A-aktier som handlas på börserna Shanghai Hong-Kong Stock Connect eller Shenzhen Hong-Kong Stock Connect (”**Stock Connect programmen**”) och som är komponenter i MSCI China All Shares Index.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Jämförelseindexet består av A-aktier som ingår i MSCI China All Shares Index. MSCI China All Shares Index är representativt för medelstora och stora företag inom området med företag som bildats i Kina eller utanför Kina men som MSCI anser är kinesiska. Detta område inbegriper aktier som är noterade på Hongkong-, Shanghai- och Shenzhenbörsen eller på börser utanför Kina. Jämförelseindexet är ett index viktat efter fritt omsättningsbart börsvärde, vilket innebär att vikten för var och en av dess komponenter är proportionell mot dess fria omsättningsbara börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NU718708
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad
Aktieexponering	Volatilitet
Indirekt replikering	Hållbarhet
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

AMUNDI MSCI EM ASIA

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Emerging Markets Asia Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i tillväxtländer i Asien (enligt definitionen i indexmetoden).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGFA
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indirekt replikering
Derivat	Investeringsfond
Tillväxtmarknader	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF - USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Emerging Markets Latam Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i tillväxtländerna i Latinamerika (enligt definitionen i indexmetoden).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGFL
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indirekt replikering
Derivat	Investeringsfond
Tillväxtmarknader	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF - USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Emerging Markets Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Emerging Markets (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i tillväxtländer (enligt definitionen i indexmetoden).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGF
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indirekt replikering
Derivat	Investeringsfond
Tillväxtmarknader	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF EUR Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF USD Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI ex Switzerland ESG Broad CTB Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index (det ”**överordnade indexet**”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 14 av 15 länder med utvecklade marknader i Europa (exklusive Schweiz). Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.
Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXESEBNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:

Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk

1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Hållbara investeringar
Derivat	Användning av tekniker och instrument
Aktieexponering	Förvaltning
Indexreplikering	Marknad
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”**MSCI**”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe Growth

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Growth Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas på marknaderna i industriländer i Europa (enligt definitionen i indexmetoden) och som representerar tillväxtaktier.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet är en underkategori till MSCI Europe index.

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för MSCI Europe Index till att täcka cirka 85 % (+/-5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde.

MSCI Europe Growth Index omfattar aktier i företag som har potential för att öka sina vinster och som har finansiella nyckeltal som generellt är högre än genomsnittet för sin sektor och dess marknad, vilket kan leda till att värdet på aktien stiger.

Tillväxtegenskaperna för investeringsinriktningen för indexkonstruktion definieras med hjälp av fem variabler: tillväxthastighet för långsiktig framtida vinst per aktie, tillväxthastighet för kortsiktig framtida vinst per aktie, aktuell intern tillväxthastighet och trend för långsiktig historisk vinsttillväxt per aktie, samt trend för långsiktig historisk försäljningstillväxt per aktie.

Varje säkerhet får tillväxtbetyg och placeras sedan i tillväxtindexet. Varje aktie i indexet viktas enligt det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet och dess tillväxtbetyg.

Indexrevision

Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSGEUNTR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 52 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
UCITS ETF DIST	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe High Dividend Factor

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe High Dividend Yield Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande aktier som handlas på marknader i Europa och som har den högsta direktavkastningen i sina respektive industriländer (enligt indexmetoden).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
MSCI Europe High Dividend Yield Index är en underkategori till MSCI Europe index.

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för MSCI Europe Index till att täcka cirka 85 % (+/-5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde.

Indexet är utformat för att återspegla resultatet för aktier i MSCI Europe Index (exklusive REITs) med högre utdelningsintäkter och kvalitetsegenskaper än genomsnittliga direktavkastande aktier som är både hållbara och ihållande.

Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M1EUHDVD
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Stil
Indirekt replikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe Minimum Volatility Factor

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Minimum Volatility Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för en portfölj med aktier i MSCI Europe-index, vilka valts ut för att få den lägsta möjliga absoluta volatiliteten i portföljen och samtidigt följa de fördefinierade riskspridningskraven (till exempel lägsta och högsta viktningar av värdepapper, sektorer och/eller länder jämfört med MSCI Europe-index).
Portföljens volatilitet är ett mått på risken. Den består av kvantifiering av storleken på portföljens värdevariationer – både positiva och negativa – under en viss period. Ju högre volatiliteten är, desto mer riskfylld kommer följaktligen investeringen i denna portfölj anses vara, och desto större kommer risken för förlust och/eller förväntningarna på vinst att vara.
Låg volatilitet innebär dock inte en riskfri investering.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning

MSCI Europe Minimum Volatility Index består av aktier i MSCI Europe Index. Dessa aktier väljs ut baserat på en systematisk kvantitativ optimeringsteknik som utförs i de två steg som beskrivs nedan.

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för MSCI Europe Index till att täcka cirka 85 % (+/-5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde.

Sammansättningen av MSCI Europe Minimum Volatility Index är en tvåstegsprocess:

1. Fastställande av en rad riskdiversifieringskrav, såsom de lägsta och högsta viktningarna som gäller för varje värdepapper, för varje sektor och land för att erhålla en portföljstruktur som liknar MSCI Europe Index.
2. Urval och viktning av aktierna i portföljen med hjälp av den systematiska kvantitativa optimeringsmatrisen för portföljen (användning av Barra Optimizer-modellen) som tar hänsyn till:

– absolut historisk volatilitet i aktierna
– kraven på riskspridning, och
– en matris med korrelationer med komponenterna i MSCI Europe Index.

Indexrevision

Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MAEUVOE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Stil
Indirekt replikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe Momentum Factor

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Momentum Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för aktier från industriländer i Europa (enligt definitionen i indexmetoden) som har uppvisat bäst resultat under de sex och tolv månader som föregår indexets sista ombalanseringsdag.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
MSCI Europe Momentum Index är en underkategori till MSCI Europe Index.

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för MSCI Europe Index till att täcka cirka 85 % (+/-5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde.

Aktier som ingår i MSCI Europe Momentum Index väljs ut på grundval av en strategi för innehav av de aktier som har uppvisat bäst resultat under de sex och tolv månader som föregår indexets sista ombalanseringsdag. Med tanke på att prisuppgången på dessa aktier tenderar att fortsätta på kort sikt, vanligtvis från sex till tolv månader. Det kan dock inte garanteras att MSCI Europe Momentum Index uppvisar ett bättre resultat jämfört med MSCI Europe Index.

Varje aktie får momentumbetyg och placeras sedan i momentumindexet. Varje aktie i indexet viktas enligt det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet och dess momentumbetyg.

Ingen aktie får ha en viktning större än 5 % på varje ombalanseringsdag.

Indexrevision
Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MEUMMT
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Stil
Indirekt replikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe Quality Factor

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Quality Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för aktier som handlas på de stora aktiemarknaderna i industriländer i Europa (enligt definitionen i indexmetoden) med en långsiktig potential för kvalitetstillväxt.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning

Indexet är en underkategori till MSCI Europe index.

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för MSCI Europe Index till att täcka cirka 85 % (+/-5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde.

Indexet syftar till att ta till vara resultaten för aktier med kvalitetstillväxt genom att identifiera aktier med höga kvalitetsbetyg baserade på tre huvudsakliga fundamentala variabler: hög avkastning på eget kapital (ROE), stabil årlig resultattillväxt och låg finansiell hävstång. Det kan dock inte garanteras att MSCI Europe Quality Index uppvisar ett bättre resultat på lång sikt jämfört med MSCI Europe Index. Ett betyg beräknas också för varje aktie med hjälp av dessa kriterier.

Aktierna viktas efter sitt börsvärde och sitt betyg.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M7EUQU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier.
Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Indirekt replikering	Stil

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe Value Factor

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Value Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande aktier i industriländer i Europa (enligt definitionen i indexmetoden) som uppvisar övergripande värdeinriktningsegenskaper.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro.

Indexets sammansättning

MSCI Europe Value Index är en underkategori till MSCI Europe Index.

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för MSCI Europe Index till att täcka cirka 85 % (+/-5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde.

MSCI Europe Value Index omfattar aktier i företag som är undervärderade av marknaden i förhållande till värdet på deras tillgångar och deras vinsttillväxt. Följaktligen finns det potential för att aktiernas verkliga värde ska stiga.

Värdeinriktningsegenskaperna för investering för indexkonstruktion definieras med hjälp av tre variabler: bokfört värde jämfört med priset, 12 månaders framtida avkastning jämfört med priset samt direktavkastning.

Varje aktie får värdebetyg och placeras sedan i värdeindexet. Varje aktie i indexet viktas enligt det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet och dess värdebetyg.

Indexrevision
Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSVEUNTR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Investeringsfond
Aktier	Stil
Indexreplikering	Marknad
Indirekt replikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI India Swap II

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI India Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas på den indiska marknaden.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den indiska marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDEUSIA
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indirekt replikering
Derivat	Investeringsfond
Tillväxtmarknad	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF EUR Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,70 %	0,10 %
UCITS ETF USD Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,70 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Nordic

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Nordic Countries Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande aktier som handlas på de nordiska marknaderna (Danmark, Finland, Norge och Sverige).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDENCN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktier	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och
Investeringsfond	Instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Switzerland

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Switzerland Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas på den schweiziska marknaden. Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den schweiziska marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).
MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDESZN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Indirekt replikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF – CHF	CHF	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi PEA MSCI USA ESG Selection

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI USA Index (”**moderindex**”), som är representativt för värdepapper från stora och medelstora företag på den amerikanska marknaden emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.
Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet. Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i MSCI USA Index, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXUSESL5
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbar investering
Indirekt replikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI USA Minimum Volatility Factor

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI USA Minimum Volatility Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex.
Indexet mäter resultatet för en minsta variansstrategi som tillämpas på det amerikanska aktieutbudet av stora och medelstora företag, som valts ut baserat på en systematisk kvantitativ optimeringsmodell (Barra Optimizer-modellen). Denna modell strävar efter att uppnå lägsta möjliga absoluta volatilitet för portföljen via krav på spridning av fördefinierade risker (d.v.s. lägsta och högsta viktning av värdepapper och sektorer med avseende på MSCI USA-indexet), med en portföljstruktur nära den för MSCI USA Index.
Portföljens volatilitet är ett mått på risken. Den består av kvantifiering av storleken på portföljens värdevariationer – både positiva och negativa – under en viss period. Ju högre volatiliteten är, desto mer riskfylld anses följaktligen investeringen i denna portfölj och desto större kommer förväntningarna på vinst och/eller risken för förlust att vara. Låg volatilitet innebär dock inte en riskfri investering.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet beräknas genom optimering av indexet, dess överordnade index, i USD för den lägsta absoluta risken (inom en given uppsättning begränsningar).

Sammansättningen av indexet är en tvåstegsprocess:

1. Fastställande av en rad riskdiversifieringskrav, såsom de lägsta och högsta viktningarna som gäller för varje värdepapper och för varje sektor för att erhålla en portföljstruktur som liknar MSCI USA Index.
2. Urval och viktning av aktierna i portföljen med hjälp av den systematiska kvantitativa optimeringsmatrisen för portföljen (användning av Barra Optimizer-modellen) som tar hänsyn till:
   – absolut historisk volatilitet i aktierna
   – kraven på riskspridning, och
   – en matris med korrelationer med komponenterna i MSCI USA Index.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M1USMVOL

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Indirekt replikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI World Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI WORLD Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i industriländer enligt definitionen i indexmetoden.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDEWIN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Indirekt replikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF EUR Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,28 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,28 %	0,10 %
UCITS ETF USD Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,28 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Core MSCI World Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI WORLD Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag utvecklade länder.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Alla aktier i indexet viktas enligt storleken på deras justerade fritt flytande börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDDUWI
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap.

Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Indirekt replikering	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Global Bioenergy

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg BioEnergy Screened Index ("**indexet**") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är konstruerat för att följa resultatet för företag som förväntas generera en betydande del av intäkterna från produktion, lagring och distribution av etanol, biodiesel och förnybart bränsle. Dessutom måste värdepapper uppfylla vissa ESG-minimistandarder.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
För att ett värdepapper ska väljas till indexet måste det ingå i Bloomberg BioEnergy Benchmark Index ("**moderindexet**"). Moderindexets värdepapper uppfyller följande urvalskriterier:
- ingå i investeringsområdena utvecklade marknader, Kina eller Sydkorea
- klassificeras som tillhörande guld- eller silvernivåerna inom biobränsleekosystemet enligt Bloomberg Intelligence (BI) Theme-Basket-kommittén
- ha ett minsta fritt omsättningsbart börsvärde på 200 miljoner US-dollar
- ha ett lägsta 90-dagars genomsnittligt dagligt handelsvärde på 2 miljoner US-dollar.

Värdepapperen granskas beträffande eventuell inblandning i kontroversiella ESG-verksamheter, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: BBIOEN

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om "hållbara investeringar" i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "replikeringsmetoder".

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten "Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering" och "Replikeringsmetoder" i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktier	Hållbar investering
Indexreplikering	Användning av tekniker och
Investeringsfond	Instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativt	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi MSCI World Ex Europe

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI WORLD CLIMATE CHANGE Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i industriländer (enligt definitionen i indexmetoden), exklusive länder i Europa.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den underliggande marknadens justerade omsättningsbara börsvärde. Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).
MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDEWEUN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Hållbarhet
Aktier	Marknad
Indexreplikering	Investeringsfond
Indirekt replikering	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standardmetoder
Operativt	Likviditet

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Nasdaq-100 Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för NASDAQ-100 Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som representerar värdepapper emitterade av icke-finansiella företag noterade på NASDAQ-börsen, en amerikansk marknad som specifikt omfattar amerikanska och icke-amerikanska aktier.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet speglar företag inom stora branschgrupper, inklusive hårdvara och programvara, telekommunikation, detaljhandel/grossisthandel och bioteknik. Det innehåller inte aktier från finansiella företag, inklusive investmentbolag. Varje aktie i indexet viktas enligt dess börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Nasdaq.
Indexet beräknas av NASDAQ OMX med hjälp av de officiella stängningskurserna på den NASDAQ-börs där de värdepapper som ingår i indexet handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: XNDX
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Nasdaq-indexet finns på www.indexes.nasdaqomx.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indirekt replikering
Derivat	Investeringsfond
Aktieexponering	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.
Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF EUR Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,10 %
UCITS ETF USD Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Produkterna sponsras, rekommenderas, säljs eller marknadsförs inte av NASDAQ OMX Group, Inc. eller dess närstående företag (NASDAQ OMX med dess närstående företag, kallas ”bolagen”). Bolagen har inte kontrollerat lagligheten eller lämpligheten i, eller riktigheten eller korrektheten i beskrivningar och upplysningar som rör produkten/produkterna. Bolagen gör inga utfästelser eller garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av produkterna eller någon medlem av allmänheten om lämpligheten i att investera i värdepapper i allmänhet eller i produkterna i synnerhet, eller förmågan hos Nasdaq-100 Index® att följa allmänna börsresultat. Bolagens enda förhållande till Amundi Investment Solutions (”Amundi Asset Management”) är licensiering av de registrerade varumärkena NASDAQ®, OMX®, NASDAQ OMX®, Nasdaq-100® och Nasdaq-100 Index®, och vissa varunamn för bolagen och användningen av Nasdaq-100 Index® som fastställs, sätts samman och beräknas av NASDAQ OMX utan hänsyn till Amundi Asset Management eller produkterna. NASDAQ OMX har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller till ägarna av produkterna när Nasdaq-100 Index® fastställs, sätts samman och beräknas. Bolagen är inte ansvariga för och har inte deltagit i fastställandet av tidpunkten för, priserna vid eller kvantiteter av den eller de produkter som ska utfärdas eller vid fastställandet eller beräkningen av den ekvation genom vilken produkterna ska omvandlas till kontanter. Bolagen har inget ansvar i samband med administration, marknadsföring eller handel med produkterna.

BOLAGEN GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER OAVBRUTEN BERÄKNING AV NASDAQ-100 INDEX® ELLER NÅGON DATA SOM INGÅR DÄRI. BOLAGEN GER INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM AMUNDI ASSET MANAGEMENT, PRODUKTERNAS ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG TILL FÖLJD AV ANVÄNDNING AV NASDAQ-100 INDEX® ELLER DATA DÄRI. BOLAGEN GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE BETRÄFFANDE NASDAQ-100 INDEX® ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA BOLAGEN UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR FÖRLORADE VINSTER ELLER SÄRSKILDA, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR, ÄVEN OM DET MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN TILL SÅDANA SKADOR.

Amundi Gold Miners

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Solactive Developed Markets Pure Gold Miners Index NTR (USD) (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som representerar globala aktier inom guldbrytning. Beståndsdelarna i i indexet måste vara medlemmar i Solactive GBS Global Markets Precious Metals All Cap USD Index PR (det ”**överordnade indexet**”), däribland alla börshandlade amerikanska depåbevis (”ADR”) för respektive godtagbart företag.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Godtagbara företag måste klassificeras som företag på utvecklade marknader eller tillväxtmarknader enligt Solactive Global Benchmark Series och vara noterade via amerikanska depåbevis. Dessutom måste de godtagbara företagen ingå i kategorin guldbrytning i det överordnade indexet. Endast en andelsklass per godtagbart företag får inkluderas. Fastställandet av indexets investeringsområde är helt regelbaserat, och Solactive kan inte fatta några beslut efter eget gottfinnande.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: SODPGMN

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.00 (Paristid). Vid indexberäkningen används köpkurser. Obligationer som läggs till i en ombalansering tas med i indexet till säljkursen på den aktuella ombalanseringsdagen.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen:
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Koncentration	Marknad
Derivat	Aktier i små och medelstora företag Volatilitet
Aktieexponering	
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond Förvaltning	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DIST	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,55 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

AMUNDI PEA DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Dow Jones Industrial Average Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett prisviktat mått på 30 amerikanska ledande storföretag. Indexet omfattar alla branscher utom transportsektorn och den allmännyttiga sektorn.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Dow Jones Industrial Average är ett prisviktat index som följer 30 ledande amerikanska företag som är representativa för den totala marknaden för amerikansk industri med undantag för transportsektorn och den allmännyttiga sektorn.
Indexkomponenter väljs ut av en indexkommitté bestående av tre representanter för S&P Dow Jones-index och två representanter för Wall Street Journal och aktier läggs vanligtvis endast till om företaget har ett utmärkt anseende, uppvisar en hållbar tillväxt och är av intresse för ett stort antal investerare.
Ändringar i indexets sammansättning publiceras av redaktörerna för Wall Street Journal utan att rådfråga de företag som är representerade i indexet eller någon börs, officiellt organ eller utgivare. Komponenter läggs till och tas bort från indexet vid behov och vanligtvis endast vid sällsynta tillfällen, med ändringar som vanligen sker efter företagsförvärv eller andra betydande ändringar i ett komponentföretags verksamhet. Tidigare gjordes de flesta justeringar till följd av sammanslagningar.
Från tid till annan görs dock ändringar för att uppnå, enligt redaktören för Wall Street Journal, en mer exakt representation av den totala marknaden för industrin i USA. Redaktörerna för Wall Street Journal anser att ledande industriföretag är potentiella nya företag som är av brett intresse för investerare och har en framgångsrik historia av tillväxt. Indexets sammansättning kan ändras när som helst och av vilken anledning som helst.

Indexrevision
Ombalanseringen av indexet planeras efter behov.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Standard & Poor's (”**S&P**”).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: DJINR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på www.eu.spindices.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Investeringsfond
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Volatilitet
Indirekt replikering	Hållbarhet
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,35 %	0,10 %
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,35 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ("**S&P**"). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS INDEXET ATT FÖLJA RESULTATET FÖR VISSA FINANSIELLA MARKNADER OCH/ELLER DELAR DÄRAV OCH/ELLER GRUPPER AV TILLGÅNGAR ELLER TILLGÅNGSKLASSER. S&P:S ENDA RELATION MELLAN S&P OCH AMUNDI ÄR LICENSIERING AV VISSA VARUMÄRKEN OCH HANDELSNAMN OCH INDEXET, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV S&P UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DELFONDEN. S&P HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL AMUNDIS ELLER INVESTERARNAS BEHOV NÄR INDEXET FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLANDET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNA OMVANDLAS TILL KONTANTER. S&P HAR INGA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER HANDEL MED DELFONDEN.

S&P GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN HOS INDEXET ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÄSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Russell 2000

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Russell 2000 Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för 2 000 småföretag vars aktier handlas på den amerikanska marknaden. Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet är en underkategori till Russell 3000 Index, som representerar cirka 99 % av den amerikanska aktiemarknaden.

Indexet innehåller de 2 000 minsta börsvärdena på den amerikanska marknaden och tas från Russell 3000 Index.
Russell 3000 Index omfattar inte:
- värdepapper där börsvärdet understiger 30 miljoner US-dollar
- värdepapper som handlas under 1 US-dollar
- värdepapper som handlas på någon av marknaderna ”Pink Quote” eller ”Bulletin Board”
- sluten fond, ”begränsade partnerskap” och ”rojalty-stiftelser”, etc.
- utländska aktier och amerikanska depåbevis (ADR)
- noterade REITs och PTPs.

Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske årsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Russell.
Indexet beräknas med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: RU20N30U
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Russell-index finns på www.ftse.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Investeringsfond
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Aktier i små och medelstora
Indirekt replikering	företag Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
UCITS ETF – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Indexet är ett varumärke som tillhör Frank Russell Company (”**Russell**”) och har licensierats för användning av Amundi Asset Management. Delfonden sponsras, rekommenderas, säljs eller marknadsförs inte på något sätt av Russell eller företag som är en del av London Stock Exchange Group (”**LSEG**”) (tillsammans ”**licensgivarparterna**”) och ingen av licensgivarparterna gör något som helst anspråk på, förutsägelse om, ger garanti för eller representation av, vare sig uttryckligen eller underförstått, vad gäller (i) de resultat som ska uppnås genom användning av indexet (på vilket delfonden är baserad), (ii) den siffra vid vilken indexet sägs befinna sig vid en viss tidpunkt på en viss dag eller på annat sätt, eller (iii) indexets lämplighet för det ändamål för vilket det används i samband med delfonden. Ingen av licensgivarparterna har tillhandahållit eller tillhandahåller finansiell rådgivning eller investeringsrådgivning eller rekommendation i förhållande till indexet till Amundi Asset Management eller till dess kunder. Indexet beräknas av Russell eller dess ombud. Ingen av licensgivarparterna ska (a) hållas ansvarig (vare sig på grund av oaktsamhet eller annat) gentemot någon person för eventuella fel i indexet och (b) ingen av licensgivarparterna är skyldig att meddela någon person om fel däri.

Amundi S&P 500 Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för S&P 500 Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för de 500 ledande värdepapperen som handlas i USA.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Alla aktier i indexet viktas efter det justerade fritt omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Standard & Poor's (”**S&P**”).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPTR500N
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på www.eu.spindices.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Indirekt replikering
Aktieexponering	Investeringsfond Hållbarhet
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF EUR Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF USD Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF USD DIST	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,18 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ("**S&P**"). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS INDEXET ATT FÖLJA RESULTATET FÖR VISSA FINANSIELLA MARKNADER OCH/ELLER DELAR DÄRAV OCH/ELLER GRUPPER AV TILLGÅNGAR ELLER TILLGÅNGSKLASSER. S&P:S ENDA RELATION MELLAN S&P OCH AMUNDI ÄR LICENSIERING AV VISSA VARUMÄRKEN OCH HANDELSNAMN OCH INDEXET, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV S&P UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DELFONDEN. S&P HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL AMUNDIS ELLER INVESTERARNAS BEHOV NÄR INDEXET FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLANDET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNA OMVANDLAS TILL KONTANTER. S&P HAR INGA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER HANDEL MED DELFONDEN.

S&P GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN HOS INDEXET ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÄSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi S&P 500 Buyback

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för S&P 500 Buyback Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för de 100 ledande företagen i S&P 500 Index med den högsta återköpskvoten under de senaste tolv månaderna.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet omfattar de 100 ledande företagen i S&P 500 Index som har köpt tillbaka sina aktier under de senaste tolv månaderna.
Vid varje tillfälle som indexet revideras definieras ett företags återköpskvot som det kontantbelopp som företaget betalat för att köpa tillbaka sina egna aktier under de senaste tolv månaderna dividerat med företagets totala börsvärde enligt notering i början av den senaste tolvmånadersperioden.
Aktierna i indexet viktas lika vid varje revideringstillfälle för indexet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Standard & Poor's (”**S&P**”).
Indexet beräknas med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets aktiekomponenter handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPBUYUN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på www.eu.spindices.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Stil
Indirekt replikering	Hållbarhet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.
Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.
Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.
Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG (”**S&P**”). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS INDEXET ATT FÖLJA RESULTATET FÖR VISSA FINANSIELLA MARKNADER OCH/ELLER DELAR DÄRAV OCH/ELLER GRUPPER AV TILLGÅNGAR ELLER TILLGÅNGSKLASSER. S&P:S ENDA RELATION MELLAN S&P OCH AMUNDI ÄR LICENSIERING AV VISSA VARUMÄRKEN OCH HANDELSNAMN OCH INDEXET, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV S&P UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DELFONDEN. S&P HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL AMUNDIS ELLER INVESTERARNAS BEHOV NÄR INDEXET FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLANDET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNA OMVANDLAS TILL KONTANTER. S&P HAR INGA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER HANDEL MED DELFONDEN.

S&P GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN HOS INDEXET ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÄSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Global Luxury

(till den 20 september 2026)

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för S&P Global Luxury Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex bestående av 80 av de största börsnoterade företagen som sysslar med produktion eller distribution av lyxvaror eller tillhandahåller lyxtjänster.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Investeringsområdet utgörs av aktier noterade på börser på utvecklade och tillväxtmarknader. Varje aktie tilldelas ett ”lyxexponeringsbetyg” (luxury exposure score) grundat på verksamhetsbeskrivning, intäktssegment och marknadsuppfattning.

Lyxaktierna rankas i fallande ordning efter deras totala börsvärde och lyxexponeringsbetyg. De första 80 ingår sedan i indexet.

Varje aktie i indexet viktas enligt storleken på deras börsvärde och lyxexponeringsbetyg. Ingen komponent utgör mer än 8 % av indexet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske årsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Standard & Poor's (”**S&P**”).
Indexet beräknas av S&P med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPGLGUN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på www.eu.spindices.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Indirekt replikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och

söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF USD Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0 150 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG (”**S&P**”). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS INDEXET ATT FÖLJA RESULTATET FÖR VISSA FINANSIELLA MARKNADER OCH/ELLER DELAR DÄRAV OCH/ELLER GRUPPER AV TILLGÅNGAR ELLER TILLGÅNGSKLASSER. S&P:S ENDA RELATION MELLAN S&P OCH AMUNDI ÄR LICENSIERING AV VISSA VARUMÄRKEN OCH HANDELSNAMN OCH INDEXET, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV S&P UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DELFONDEN. S&P HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL AMUNDIS ELLER INVESTERARNAS BEHOV NÄR INDEXET FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLANDET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNA OMVANDLAS TILL KONTANTER. S&P HAR INGA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER HANDEL MED DELFONDEN.

S&P GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN HOS INDEXET ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÄSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Global Luxury

(Från och med den 21 september 2026)

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för S&P Global Luxury Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex bestående av 80 av de största börsnoterade företagen som bedriver verksamhet inom produktion eller distribution av lyxvaror eller tillhandahåller lyxtjänster.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Investeringsområdet utgörs av aktier noterade på börser på utvecklade marknader och tillväxtmarknader. Varje aktie tilldelas ett lyxexponeringsbetyg (luxury exposure score) grundat på verksamhetsbeskrivning, intäktssegment och marknadsuppfattning.

Lyxaktierna rankas i fallande ordning efter deras totala börsvärde och lyxexponeringsbetyg. De första 80 ingår sedan i indexet.

Varje aktie i indexet viktas enligt storleken på deras börsvärde och lyxexponeringsbetyg. Ingen komponent utgör mer än 8 % av indexet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske årsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Standard & Poor's (”**S&P**”).
Indexet beräknas av S&P med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPGLGUN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index. Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på www.eu.spindices.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 55 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Replikering av samplingsindex
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Hållbarhet
	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF USD Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR’S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG (”**S&P**”). S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS INDEXET ATT FÖLJA RESULTATET FÖR VISSA FINANSIELLA MARKNADER OCH/ELLER DELAR DÄRAV OCH/ELLER GRUPPER AV TILLGÅNGAR ELLER TILLGÅNGSKLASSER. DEN ENDA RELATIONEN MELLAN S&P OCH AMUNDI ÄR LICENSIERING AV VISSA VARUMÄRKEN, HANDELSNAMN OCH INDEXET, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV S&P UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DELFONDEN. S&P HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL AMUNDIS ELLER INVESTERARNAS BEHOV NÄR INDEXET FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN, ELLER VID FASTSTÄLLANDET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNA OMVANDLAS TILL KONTANTER. S&P HAR INGA SKYLDIGHETER OCH INGET ANSVAR I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER HANDEL MED DELFONDEN.

S&P GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN HOS INDEXET ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÄSTELSER BETRÄFFANDE RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER EFTERFÖLJANDE SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Smart Cities

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI ACWI IMI Smart Cities Filtered Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet strävar efter att representera resultatet för företag som förväntas få betydande intäkter från verksamheter som är förknippade med utveckling av nya produkter och tjänster som är inriktade på smarta lösningar för stadsinfrastruktur och som utesluter företag som ligger efter med miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”**ESG**”) i förhållande till temats område, enligt närmare beskrivning i
Bilaga I – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning

Indexet sätts samman genom urval av aktier från MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”**överordnat index**”), (dvs. inklusive aktier i stora, medelstora och små företag i utvecklade länder och tillväxtländer).

Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som:
- Smart anslutning (IoT)
- Smart infrastruktur
- Smarta byggnader
- Smarta hem
- Smart säkerhet
- Smart mobilitet
- Smart avfalls- och vattenhantering
- Smart energi och elnät

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXACSMRT
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 52 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Tillväxtmarknader	Aktier i små och medelstora företag

Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,35 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Core Stoxx Europe 600

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för STOXX Europe 600 Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet ger exponering mot resultatet för aktierna i de 600 mest likvida stora, medelstora och små företagen på utvecklade marknader i Europa.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet är justerat för fritt omsättningsbart börsvärde, med ett viktningstak på 20 %. Komponenter granskas beträffande ett likviditetskriterium:
Varje komponent måste ha en minsta likviditet på mer än 1 miljon euro, enligt sin genomsnittliga dagliga handelsvolym på 3 månader (ADTV).

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SXXR
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Aktier i små och medelstora företag Hållbarhet
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF USD HEDGED Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,05 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,02 %	0,05 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,03 %
UCITS ETF EUR Hedged Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare lämnar inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi MSCI Robotics & AI

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI ACWI IMI Robotics & AI Filtered Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet strävar efter att återspegla resultatet för företag som är förknippade med den ökade användningen av artificiell intelligens, robotar och automatisering och samtidigt utesluta företag som ägnar sig åt vissa kontroversiella verksamheter eller som har låga betyg och kontroversbetyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”**ESG**”). Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som:

- robotteknik/artificiell intelligens
- IoT/smarta hem
- molntjänster
- cybersäkerhet
- medicinsk robotteknik
- automatisering av sociala medier
- automatisering av fordon.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet har följande egenskaper:

a) Samma investeringsområde som MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”**moderindexet**”), dvs. inklusive aktier i stora, medelstora och små företag i utvecklade länder och tillväxtländer.
b) En uppsättning relevanta ord och fraser som härrör från ovanstående affärsverksamheter används för att identifiera företag (”**det godtagbara investeringsområdet**”) som kan dra nytta av den ökade användningen av produkter och tjänster som är inriktade på automatisering och artificiell intelligens.
c) Företag från det godtagbara investeringsområdet med ett ”relevansbetyg” (enligt MSCI:s definition) över 25 % utgör det ”valda investeringsområdet”.
d) Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sektor tillämpas på det valda investeringsområdet.
e) Ett ESG-urval för uteslutning tillämpas enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXACIREF
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Koncentration	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Indirekt replikering	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Prime Emerging Markets

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa utvecklingen för Solactive GBS Emerging Markets Large & Mid Cap USD Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora bolag i 26 tillväxtländer (gäller från oktober 2020).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexkomponenterna är representativa för de största 85 % (+/- 5 %) av det fria omsättningsbara börsvärdet i 26 tillväxtekonomier (per oktober 2020).

Det fria omsättningsbara börsvärdet beräknas genom att multiplicera de fria omsättningsbara utestående aktierna med andelsklassens kurs på urvalsdagen.

Indexet är en sammansättning av utvalda aktier från varje land.

Aktierna viktas enligt deras fria omsättningsbara börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: SEMLMCUN

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond Förvaltning
Derivat	Marknad
Tillväxtmarknader	Hållbarhet
Aktieexponering	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Operativ	Likviditet
Motpart	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Prime Europe

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa utvecklingen för Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i 15 industriländer i Europa.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexets komponenter är noterade och handlas i 15 industriländer i Europa: Österrike, Belgien, Danmark, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Norge, Portugal, Spanien, Sverige, Schweiz, Storbritannien.

För varje land rangordnas indexets komponenter efter fritt omsättningsbart börsvärde i fallande ordning, och de aktier som motsvarar stora och medelstora företag väljs ut.

Det fria omsättningsbara börsvärdet beräknas genom att multiplicera de fria omsättningsbara utestående aktierna med andelsklassens kurs på urvalsdagen.

Indexet är en sammansättning av utvalda aktier från varje land.

Aktierna viktas enligt deras fria omsättningsbara börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Solactive GBS officiella index beräknas av Solactive utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SEULMCEN

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Prime Eurozone

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa utvecklingen för Solactive GBS Developed Markets Eurozone Large & Mid Cap Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för de stora och medelstora marknaderna i 10 utvecklade eurozonländer (per oktober 2020).
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexkomponenterna är representativa för de största 85 % (+/- 5 %) av det fria omsättningsbara börsvärdet i tio utvecklade länder i euroområdet: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien (från och med oktober 2020).

Det fria omsättningsbara börsvärdet beräknas genom att multiplicera de fria omsättningsbara utestående aktierna med andelsklassens kurs på urvalsdagen.

Aktierna viktas enligt deras fria omsättningsbara börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Indexet beräknas dagligen med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: SEZLMCN

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid).

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 65 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.
Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Aktieexponering	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond	Marknad
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Prime Japan

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa utvecklingen för Solactive GBS Japan Large & Mid Cap Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för de stora och medelstora värdepapper som är noterade och handlas i Japan. Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Japansk yen

Indexets sammansättning
Indexets beståndsdelar rangordnas efter fritt omsättningsbart börsvärde i fallande ordning, och motsvarar stora och medelstora företag.
Det fria omsättningsbara börsvärdet beräknas genom att multiplicera de fria omsättningsbara utestående aktierna med andelsklassens kurs på urvalsdagen.
Alla aktier i indexet viktas efter deras fritt omsättningsbara börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Solactive GBS officiella index beräknas av Solactive utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SJPLMCN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive GBS Japan Large & Mid Cap Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Japansk yen

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och Instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	JPY	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Prime UK MID And Small Cap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Solactive United Kingdom Mid and Small Cap ex Investment Trust Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för marknaden för medelstora och små företag som är noterade och handlas i Storbritannien.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Brittiska pund

Indexets sammansättning
Det inledande investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i Solactive GBS United Kingdom All Cap Index (det ”**överordnade indexet**”). Moderindexet består av aktier i små, medelstora och stora bolag som omfattar alla segment på den brittiska globala aktiemarknaden.
Värdepapperen rangordnas i fallande ordning efter sitt totala börsvärde. De 100 största värdepapperen är uteslutna från det godtagbara investeringsområdet.

Inkludering i indexet baseras sedan på följande kriterier:
- Värdepapperen måste vara noterade på Londonbörsen
- Handelsvaluta i GBP
- Värdepapper som för närvarande ingår i indexet måste ha ett genomsnittligt dagligt handelsvärde på minst 750 000 USD under den föregående 1-månadsperioden och 6-månadsperioden för att förbli godtagbara
- För att bli godtagbara måste värdepapper som för närvarande inte ingår i indexet ha ett genomsnittligt dagligt handelsvärde på minst 1 000 000 USD under den föregående 1-månadsperioden och 6-månadsperioden

Bland återstående värdepapper väljs de 150 värdepapper som har högst fritt omsättningsbart börsvärde ut som indexets beståndsdelar.
Dessa beståndsdelar viktas enligt det fria omsättningsbara börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: SOLUKMSN

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Brittiska pund

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Aktieexponering	Aktier i små och medelstora företag
Indexreplikering	Volatilitet
Investeringsfond	Hållbarhet
Förvaltning	Användning av tekniker och
Marknad	Instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Prime USA

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa utvecklingen för Solactive GBS United States Large & Mid Cap Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora aktier som är noterade och handlas i USA.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Aktierna rangordnas efter fritt omsättningsbart börsvärde i fallande ordning, och de aktier som motsvarar stora och medelstora företag väljs ut.
Det fria omsättningsbara börsvärdet beräknas genom att multiplicera de fria omsättningsbara utestående aktierna med andelsklassens kurs på urvalsdagen.
Aktierna viktas enligt deras fria omsättningsbara börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Solactive GBS officiella index beräknas av Solactive utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: SUSLMCN

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och Instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AU	USD	–	4,50 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi MSCI EM Asia SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EM Asia SRI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets (EM) (”**moderindexet**”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i nio asiatiska tillväxtmarknadsländer (per november 2021).
Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan.
Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXMSFFNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index (”**moderindexet**”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEFSXNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Externa förvaltare
Amundi Japan Ltd. (endast den asiatiska delen av portföljen).

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad
Aktieexponering	
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Landrisk – Kina	Hållbara investeringar
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,35 %	0,15 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI EMU SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EMU SRI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU index och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på tio utvecklade marknader inom europeiska ekonomiska och monetära unionen (per november 2021) (”**moderindexet**”).
Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMSXNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.
Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad

Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe SRI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Index (”**överordnat index**”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på 15 utvecklade marknader i Europa (per november 2021).
Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan.
Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUSXNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.
Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	

Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,13 %	0,05 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,20 %	0,15 %
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Japan SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa utvecklingen för MSCI Japan SRI Filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är baserat på MSCI Japan index (”**överordnat index**”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på den japanska marknaden. Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Japansk yen

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXJPSXNY
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Japansk yen

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar

Indexreplikering Investeringsfond Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	JPY	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF – CHF HEDGED	CHF	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Pacific Ex Japan SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Pacific ex Japan SRI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Pacific ex Japan Index (”**överordnat index**”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag i 4 av 5 industriländer i Stillahavsområdet undantaget Japan (per november 2021).

Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i de regionala index som utgör moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXPJSXNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad

Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
AE	EUR	1 USD	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,15 %
UCITS ETF DR – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,35 %	0,10 %
UCITS ETF DR – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI USA SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI USA SRI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är baserat på MSCI USA index och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på den amerikanska marknaden (”moderindexet”). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan.
Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i de regionala index som utgör moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXUSSXNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning

Tillväxtmarknader	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,13 %	0,05 %
AE	EUR	1 USD	4,50 %	1,00 %	0,20 %	0,15 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI World SRI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är baserat på MSCI World Index (”**överordnat index**”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på 23 utvecklade marknader (per november 2021).
Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXWOSXNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.
Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad

Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
AE	EUR	1 USD	4,50 %	1,00 %	0,20 %	0,15 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI UK IMI SRI Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI UK IMI filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI United Kingdom IMI Index (”**moderindex**”), som är representativt för värdepapper från stora, medelstora och små företag på den brittiska marknaden. Indexet ger exponering mot företag som har högsta betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i det överordnade indexet, och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan.

Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Brittiska pund

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXGBISNG
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Aktier i små och medelstora företag

Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF DR - GBP	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI EMU Screened

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EMU Screened Select ex Thermal Coal Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index (”**moderindexet**”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i länder inom EMU. Indexet utesluter också företag från moderindexet baserat på ESG-kriterier (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Indexet har som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet. Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Beståndsdelarna i indexet väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med det överordnade indexet, som beskrivs närmare i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXESCLNE

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 65 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Volatilitet	Valuta
	ESG-risker
	Aktier i små och medelstora företag

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Operativ	Likviditet
Motpart	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MDAX ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MDAX ESG+ (NR) EUR Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MDAX Index (”**moderindexet**”) som är representativt för medelstora företag i Tyskland från traditionella sektorer, inklusive media, kemi, industri och finansiella tjänster och teknik som följer de företag som ingår i MDAX vad gäller börsvärde och orderingång.

Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. För att ingå i MDAX ESG+ beaktas endast företag som är noterade på en reglerad marknad. Dessutom måste företagen visa att deras rättsliga eller operativa bas är i Tyskland eller så måste de generera huvuddelen av sin handelsomsättning på Frankfurtbörsen och ha sitt huvudkontor i en EU- eller EFTA-medlemsstat.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: MDXESGPN

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.
Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Marknad
Aktieexponering	Aktier i små och medelstora företag
Indexreplikering	Volatilitet
Investeringsfond Förvaltning	Hållbara investeringar
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,20 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi S&P 500 Screened

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för S&P 500 Scored and Screened+ Index (USD) NTR Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett brett börsvärdesviktat index som används till att mäta resultatet för värdepapper som uppfyller hållbarhetskriterierna, samtidigt som det har liknande allmän branschgruppvikt som S&P 500 (”**överordnat index**”). S&P500 Index är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas i USA.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det inledande investeringsområdet för (USD) NTR Index innehåller alla värdepapper som ingår i moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Standard & Poor's (”**S&P**”).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPXESAUN
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på www.eu.spindices.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,15 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG (”**S&P**”). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS INDEXET ATT FÖLJA RESULTATET FÖR VISSA FINANSIELLA MARKNADER OCH/ELLER DELAR DÄRAV OCH/ELLER GRUPPER AV TILLGÅNGAR ELLER TILLGÅNGSKLASSER. S&P:S ENDA RELATION MELLAN S&P OCH AMUNDI ÄR LICENSIERING AV VISSA VARUMÄRKEN OCH HANDELSNAMN OCH INDEXET, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV S&P UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DELFONDEN. S&P HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL AMUNDIS ELLER INVESTERARNAS BEHOV NÄR INDEXET FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLANDET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNA OMVANDLAS TILL KONTANTER. S&P HAR INGA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER HANDEL MED DELFONDEN.

S&P GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN HOS INDEXET ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÄSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi STOXX Europe 600 ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för STOXX Europe 600 ESG+ Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är baserat på Stoxx Europe 600 (”**moderindexet**”) som motsvarar de 600 ledande värdepappren i utvecklade länder i Europa, och som använder sektoruteslutningar och uteslutningar baserade på ESG-resultat, och har som mål att välja 80 % av de värdepapper som ingår i moderindexet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet består av de företag som ingår i moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SXXRESGP
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.
Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Derivat	Aktier i små och medelstora företag
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Operativ	Standardmetoder
Motpart	Likviditet

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi MSCI AC Far East Ex Japan ESG Selection

(Till den 14 oktober 2026)

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI Ac Far East ex Japan ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex som är baserat på MSCI AC Far East ex Japan Index (”**moderindexet**”) och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 2 utvecklade länder (utom Japan) och 7 tillväxtmarknadsländer i Fjärran Östern som är emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

US-dollar

Indexets sammansättning

Värdepapperen är de som ingår i MSCI AC Far East Ex Japan index och i ett av följande tre index: MSCI China ESG Leaders Select index, MSCI EM ex China ESG Leaders Select index och MSCI World ESG Leaders Select index, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXACFENU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)

Minst 55 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk

2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Tillväxtmarknader	Aktier i små och medelstora företag
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,35 %	0,15 %
IE	EUR	500 000 USD	2,50 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF DR – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Emerging Markets Screened

(Från och med den 15 oktober 2026)

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för MSCI EM Screened Select ex Thermal Coal Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 24 länder med tillväxtmarknader. Indexet utesluter också företaget från moderindexet baserat på ESG-kriterier (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Indexet har som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

US-dollar

Indexets sammansättning

Indexets beståndsdelar väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet, som beskrivs närmare i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMTCNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index. Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)

Minst 51 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk

2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktier på tillväxtmarknader	Aktier i små och medelstora företag
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE Acc	EUR	1 USD	4,50 %	1,00 %	0,35 %	0,15 %
IE Acc	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI China ESG Selection

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI China Index (**”moderindexet”**), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i det kinesiska aktieområdet som omfattar kinesiska A-aktier, H-aktier, B-aktier, Red chip-, P chip-aktier och utländskt noterade aktier (t.ex. amerikanska depåbevis) och är emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i MSCI China Index, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXCNEGNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Emerging Ex China ESG Selection

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EM ex China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (**”indexet”**) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets ex China Index (**”moderindex”**), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 26 av de 27 tillväxtmarknadsländerna (per januari 2021) utom Kina emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEFEGNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	3,50 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Emerging Markets ESG Selection

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EM ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index (**”överordnat index”**), representativt för de stora och mellanstora företagens värdepapper i 27 tillväxtländer (per november 2021) och emitterade av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i det överordnade indexet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i MSCI Emerging Markets Index, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEME5NU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Användning av tekniker och Instrument
Tillväxtmarknader	Hållbara investeringar
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Investeringsfond
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI EMU ESG Selection

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (**”indexet”**) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index (**”moderindexet”**), som är representativt för stora och medelstora företag i 10 industriländer (per september 2020) inom EMU och emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i MSCI EMU Index, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMUEL5
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 65 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och Instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standardmetoder
Operativ	Likviditet

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	1 USD	4,50 %	1,00 %	0,15 %	0,15 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %
UCITS ETF DR – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI USA ESG Selection

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (**"indexet"**) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI USA Index (**"moderindex"**), representativt för de stora och mellanstora företagens värdepapper på den amerikanska marknaden och emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet "Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer" i prospektet.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i MSCI USA Index, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**"MSCI"**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXUSESL5
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet "Hållbara investeringar" i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten "Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering" och "Replikeringsmetoder" i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".
Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och Instrument

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered PAB Index (**”indexet”**) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index (**”moderindexet”**), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 15 utvecklade länder i Europa.
Indexet är utformat för att stödja investerare som vill minska sin exponering mot omställningsrisker och fysiska klimatrisker och som vill eftersträva möjligheter till följd av omställningen till en ekonomi med lägre koldioxidutsläpp samtidigt som de anpassar sig till kraven i Parisavtalet.
Indexet innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformat för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet är konstruerat med hjälp av en optimeringsprocess som syftar till att uppnå replikerbarhet och investeringsbarhet.
Indexet innehåller uteslutningar enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUPFNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk motsvarande upp till 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkurssättning.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad

Aktieexponering	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Operativ	Likviditet
Motpart	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,08 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,42 %	0,08 %
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI World ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI World ESG Broad CTB Select Index (”**indexet**”) och minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI World Index (”**moderindexet**”) som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i länder med utvecklade marknader och utesluter företag från moderindexet baserat på negativa sociala och miljörelaterade kriterier.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXWOEBNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.
Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Marknad
Derivat	Hållbara investeringar
Aktieexponering	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	
Investeringsfond	Stil
Förvaltning	Aktier i små och medelstora företag

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Operativ	Likviditet
Motpart	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,13 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,37 %	0,13 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index (**”indexet”**) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index (”**moderindexet**”), som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i länder med utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUEBSL
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbar investering
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Säkringsrisk (säkrad andelsklass)

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,08 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI EMU ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EMU ESG Broad CTB Select Net Total Return Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index (”**moderindexet**”), som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i utvecklade länder i Ekonomiska och monetära unionen (”EMU”). Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMUEBL
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad

Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Volatilitet Hållbar investering
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standardmetoder
Operativ	
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,07 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Emerging Markets ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa utvecklingen för MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index (**”indexet”**) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index (”**moderindexet**”), som är representativt för marknaderna för företag med stort och medelstort börsvärde i 27 tillväxtländer (per november 2021) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.
Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (**”MSCI”**).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMEBSL
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Risk med tillväxtmarknadsland – Kina	Hållbara investeringar
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och Instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Europe Small Cap ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Small Cap Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper i små företag i länder med utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.
Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minskar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet samtidigt som man säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg och uppfyller minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för klimatomställning (EU CTB) samt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUSCCT
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Marknad
Derivat	Aktier i små och medelstora företag
Aktieexponering	Volatilitet
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Förvaltning	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi MSCI Pacific ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index (”**indexet**”) och minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Pacific Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i 5 länder med utvecklade marknader i Stillahavsområdet och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.
Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXPCCTNU
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com.

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Volatilitet
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,35 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi EUR Corporate Bond 0-1Y ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg emitterade av privata företag (så kallade företagsobligationer) med en återstående löptid på mellan en månad och ett år som tillämpar ytterligare sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet omfattar företagsobligationer med följande urvalskriterier:
- värdepapper denominerade i euro
- emittentens hemvist är inte relevant för valet av obligationer
- fasta kuponger
- investment grade-obligationer som värderats av åtminstone ett av de tre kreditvärderingsinstituten (Standard & Poors, Fitch Ratings och Moodys Investors Services). Investment grade definieras som BBB- eller högre från Fitch och S&P och Baa3 eller högre från Moodys (det betyg som används vid analysen av varje godtagbart värdepapper är genomsnittet av de kreditbetyg som utfärdats av de tre kreditvärderingsinstituten)
- löptiden vid emission måste vara längre än ett år
- återstående löptid mellan en månad och ett år
- det utestående minimibeloppet per emission är 500 miljoner euro, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Markit.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXEEC1

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid). Vid indexberäkningen används mittkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Markit-index finns på www.markit.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Derivat	Förvaltning
Indexreplikering	Marknad
Investeringsfond	Replikering av samplingsindex
Räntesats	Hållbara investeringar
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Kredit	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 1 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Det index som refereras häri tillhör Markit Indices Limited. (”**indexsponsorn**”) och har licensierats för användning i anknytning till delfonden. Vardera part bekräftar och är överens om att delfonden inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexsponsorn. Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, vare sig uttryckliga eller underförstådda, och friskriver sig härmed uttryckligen från alla garantier (inbegripet, utan begränsning, sådana som rör säljbarhet eller lämplighet för ett visst syfte eller användningsområde) beträffande indexet och alla däri ingående eller relaterade data, och friskriver sig särskilt från alla garantier beträffande kvalitet, riktighet och/eller fullständighet rörande indexet eller däri ingående data, de resultat som erhålls till följd av användning av indexet och/eller indexets sammansättning vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars och/eller någon enhets kreditvärdighet, eller sannolikheten för en kredithändelse eller liknande händelse (oavsett definition) som avser en förpliktelse, i indexet vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars.

Indexsponsorn ska inte hållas ansvarig (vare sig på grund av oaktsamhet eller annat) gentemot parterna eller någon annan person för eventuella fel i indexet och har ingen skyldighet att meddela parterna eller någon person om fel däri.

Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja delfonden, indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill eller risktagning i samband med det. Indexsponsorn har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer delfonden eller indexsponsorn har något ansvar gentemot någon part för indexsponsorns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexsponsorn och dess närstående företag får handla med alla obligationer som ingår i indexet och får, där så är tillåtet, ta emot insättningar från, utfärda lån eller på annat sätt bevilja krediter till och i allmänhet bedriva all slags affärs- eller investeringsbanksverksamhet eller annan verksamhet med sådana obligationers emittenter eller deras närstående företag och får då handla som om indexet inte existerade, oavsett om sådana handlingar inverkar negativt på indexet eller delfonden.

Amundi Global Aggregate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized Sector Neutral Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som representerar den globala marknaden för räntebärande instrument med fast ränta med höga kreditbetyg från emittenter på både utvecklade marknader och tillväxtmarknader som följer reglerna för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Index (”**överordnat index**”) och använder sektor- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
I det tillämpliga området ingår alla värdepapper som ingår i det överordnade indexet (dvs. obligationer med fast ränta och hög kreditvärdighet i lokala valutor, inklusive statspapper, statliga relaterade emittenter och företagsemittenter, med en minsta fast emissionsstorlek för alla kvalificerade valutor). En obligation tas med i indexet baserat på valutadenomineringen och inte emittentens riskland, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I36446US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Kredit	Marknad
Tillväxtmarknader	Hållbara investeringar
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Användning av tekniker och instrument

Räntesats	Replikering av samplingsindex
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,10 %
UCITS ETF DR - HEDGED EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,06 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Global Aggregate Bond 1-5Y ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sector Neutral Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för den globala marknaden för skuldförbindelser med fast ränta och höga kreditbetyg från både utvecklade marknader och tillväxtmarknader med en återstående löptid på mellan 1 och 5 år som följer reglerna för Global Agg ex Securitized 500mn 1-5 Year (”**moderindexet**”) och använder sektor- och ESG-kriterier för godtagbara värdepapper.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
I det tillämpliga området ingår alla värdepapper som ingår i det överordnade indexet (dvs. obligationer med fast ränta och hög kreditvärdighet i lokala valutor, inklusive statspapper, statliga relaterade emittenter och företagsemittenter, med en minsta fast emissionsstorlek för alla kvalificerade valutor). En obligation tas med i indexet baserat på valutadenomineringen och inte emittentens riskland, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I36756US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Tillväxtmarknader	Hållbara investeringar

Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	Replikering av samplingsindex
Räntesats	
Landrisk – Kina	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,10 %
UCITS ETF DR - HEDGED EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,06 %	0,10 %
UCITS ETF – CHF HEDGED	CHF	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,06 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Corporate 1-5 Year Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som består av företagsobligationer i flera valutor med höga kreditbetyg, fast ränta och en löptid mellan ett år och upp till, men inte inklusive fem år som använder sektor- och ESG-kriterier för säkerhetskvalificering.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet består av skuldförbindelser från företag i flera valutor med fast ränta, höga kreditbetyg och mellan ett och upp till, men inte inklusive, fem år återstående löptid och ett lägsta utestående nominellt belopp med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I36068US

Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.
Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit
Derivat
Indexreplikering
Räntesats
Investeringsfond
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
Förvaltning
Marknad
Replikering av samplingsindex
Hållbara investeringar
Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR – GBP HEDGED	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,09 %	0,06 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi EUR Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för värdepapper från företag denominerade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”**moderindexet**”) och tillämpar sektorkriterier och ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är noterade i euro med en återstående löptid på över 1 år och med ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner EUR). En obligation tas med i indexet baserat på valutadenomineringen och inte emittentens riskland, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35570EU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Replikering av samplingsindex
Investeringsfond	

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,20 %	0,15 %
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %
UCITS ETF 2 DR – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	2,00 %	0,09 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Euro Aggregate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Aggregate Sector Neutral Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som motsvarar värdepapper som är noterade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Index (**överordnat index**) och använder sektor- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. obligationer med fast ränta och höga kreditbetyg noterade i euro, inklusive statspapper, statsrelaterade emissioner, företags- och värdepapperiseringsemissioner). En obligation tas med i indexet baserat på valutadenomineringen och inte emittentens riskland, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35394EU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Replikering av samplingsindex
Räntesats	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,06 %	0,10 %
UCITS ETF DR – EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,06 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi EUR Corporate Bond 0-3Y ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corp BBB+ 0-3 Year Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för obligationer med höga kreditbetyg denominerade i euro som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”**moderindexet**”) med en återstående löptid på 0 eller 3 år och tillämpar ytterligare sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är noterade i euro och offentligt emitterade) med en återstående löptid på mellan en månad och tre år i slutet av varje månad och ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner EUR. En obligation tas med i indexet baserat på valutadenomineringen och inte emittentens riskland, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I34717EU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 1,5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på kort till medellång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa osch kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	3,50 %	1,00 %	0,03 %	0,09 %
UCITS ETF DR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,09 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi USD Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG US Corporate Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för värdepapper från företag denominerade i US-dollar med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index (”**moderindexet**”) och tillämpar sektorkriterier och ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i det överordnade indexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och offentligt emitterade med en återstående löptid på över 1 år och ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner US-dollar), enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35571US

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.00 (New York-tid).

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AE	EUR	1 USD	4,50 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Global Government Tilted Green Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Global Treasury Green Bond Tilted Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett jämförelseindex med flera valutor som mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med fast ränta för följande länder: Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA. Dessutom höjs det totala viktade marknadsvärdet för indexet gröna obligationer till 30 %.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet uppfyller följande kriterier:

- Godtagbara obligationer emitteras av följande länder: Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA.
- Det totala viktade marknadsvärdet för indexet gröna obligationer höjs till 30 %.
- Länder som klassificeras som ”inte fria” av Freedom House är uteslutna från indexet.

Ytterligare ESG-kriterier beskrivs närmare i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I40147US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om ”hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %
UCITS ETF CHF Hedged Acc	CHF	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi MSCI EMU Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered PAB Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU index som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på utvecklade marknader i Ekonomiska och monetära unionen (”**moderindexet**”).

Indexet är utformat för att stödja investerare som vill minska sin exponering mot omställningsrisker och fysiska klimatrisker och som vill eftersträva möjligheter till följd av omställningen till en ekonomi med lägre koldioxidutsläpp samtidigt som de anpassar sig till kraven i Parisavtalet. Indexet innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformade för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet är konstruerat med hjälp av en optimeringsprocess som syftar till att uppnå replikerbarhet och investeringsbarhet. Indexet innehåller uteslutningar enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMUPNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk motsvarande upp till 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkurssättning.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Investeringsfond
Räntesats	
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	
Hög avkastning	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi China CNY Bonds[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som representerar värdepapper med fast ränta utgivna av stats- och institutionella banker noterade på den kinesiska interbankmarknaden i CNY.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet omfattar skuldförbindelser med fast ränta utgivna av stats- och institutionella banker som emitterats på interbankmarknaden i Kina noterade i CNY. Värdepapperen måste ha ett utestående nominellt värde på minst fem miljarder CNY och en återstående löptid på minst ett år för att vara kvalificerade att ingå i indexet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I32561US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Indexreplikering	Marknad
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Hållbarhet
	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Replikering av samplingsindex
Tillväxtmarknader	
Landrisk – Kina	
Kredit	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

[1] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi EUR Corporate Bond 1-5Y ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate 1-5 Year Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex för företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”**moderindexet**”) och tillämpar ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i euro med en återstående löptid på över 1 år och upp till, men inte inklusive, 5 år och ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner euro).
Sedan tillämpas filtren enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I37162EU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.15 (Londontid).
Vid indexberäkningen används köpkurser.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.

Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Indexreplikering	Marknad
Investeringsfond	Hållbara investeringar
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument

Räntesats	Replikering av
Derivat	samplingsindex

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Core Global Aggregate Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Global Aggregate Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för globala fasträntepapper med hög kreditvärdighet från emittenter på både utvecklade marknader och tillväxtmarknader.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Värdepapperen som ingår i indexet har högt kreditbetyg (enligt medelbetyget från Moodys, S&P och Fitch) och har minst ett års återstående löptid.
Indexet är ett jämförelseindex med flera valutor som omfattar obligationer med fast ränta som är emitterade av stater, myndighetsrelaterade organ, företag och värdepapperiserade (inklusive MBS och ABS) med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: LEGATRUU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

- Valuta
- Derivat
- Indexreplikering
- Räntesats
- Investeringsfond
- Landrisk – Kina
- Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
- Kredit
- Förvaltning
- Marknad
- Replikering av samplingsindex
- Hållbarhet
- Användning av tekniker och instrument
- MBS/ABS/TBA

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

- Motpart
- Operativ
- Standard
- Likviditet
- Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,07 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,07 %
UCITS ETF USD HEDGED Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,07 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Core Euro Government Bond[2]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Euro Treasury 50bn Bond Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet erbjuder exponering mot räntebärande offentliga obligationer med höga kreditbetyg emitterade av suveräna stater som ingår i EMU.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet uppfyller följande kriterier:
- Endast statsobligationer ingår i indexet
- Godtagbara obligationer har ett utestående nominellt belopp på minst 1 miljard euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro vid indexets startdatum. Länder måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre) för att tas med i indexet enligt medelbetyget från Moody’s, S&P och Fitch.
- Den återstående löptiden måste vara minst ett år, oavsett optionalitet.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I35205EU

- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets** resultat som fastställs vid stängningstid på de lokala marknader som utgör indexet. Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Replikering av samplingsindex
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	
Räntesats	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

[2] (1) Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,10 %
AE	EUR	–	4,50 %	1,00 %	0,20 %	0,15 %
IE	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,05 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Core Global Government Bond[3]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för JP MORGAN Government Bond Index Global (GBI Global) Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statspapper med fast ränta.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
De värdepapper som ingår i indexet är statspapper med fast ränta som är emitterade på 13 utvecklade statsobligationsmarknader (Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA).

Indexet utesluter specifikt obligationer med mindre än ett års återstående löptid, obligationer med rörlig ränta (FRN), eviga obligationer och viktas enligt börsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av J.P. Morgan.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: JPEIGGEU

Indexets resultat som fastställs vid stängningstid på de lokala marknader som utgör indexet.

Vid indexberäkningen används mittkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i J.P. Morgan-indexet finns på www.jpmorgan.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

- Kredit
- Valuta
- Derivat
- Indexreplikering
- Investeringsfond
- Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
- Räntesats
- Förvaltning
- Marknad
- Hållbarhet
- Användning av tekniker och instrument
- Replikering av samplingsindex

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

- Motpart
- Operativ
- Standard
- Likviditet
- Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

[3] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
IE	EUR	USD 500 000	1,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,10 %
UCITS ETF USD HEDGED Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %
AHE	EUR	–	3,50 %	1,00 %	0,20 %	0,15 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

FÖRVALTNINGSBOLAGET, INVESTERINGSFÖRVALTAREN OCH DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV J.P. MORGAN OCH J.P. MORGAN GÖR INGA UTFÄSTELSER OM LÄMPLIGHETEN ATT INVESTERA I INDEXET. J.P. MORGAN GARANTERAR INTE FULLSTÄNDIGHETEN ELLER RIKTIGHETEN FÖR INDEXET. ”J.P. MORGAN” ÄR ETT REGISTRERAT TJÄNSTEMÄRKE TILLHÖRANDE JPMORGAN CHASE & CO. © 2016. JPMORGAN CHASE & CO. MED ENSAMRÄTT.

Amundi Euro High Yield Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med kreditbetyget BB/B emitterade av företagsemittenter som följer reglerna i iBoxx EUR High Yield TCA Index (”**moderindexet**”) och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexets godtagbara investeringsområde omfattar alla värdepapper som utgör moderindexet, och det består av obligationer denominerade i euro som emitterats av offentliga eller privata emittenter med följande godtagbarhetskriterier:

- Endast skuldebrev denominerade i euro från emittenter är godtagbara, oberoende av risk eller ursprung.
- Alla obligationer måste ha ett genomsnittligt kreditbetyg på BB eller B. Det genomsnittliga kreditbetyget beräknas av iBoxx, baserat på de kreditbetyg som tillhandahålls av de tre kreditvärderingsinstituten: Fitch Ratings, Moody's Investors Service eller S&P Global Ratings.
- Alla godtagbara obligationer måste ha en återstående löptid på minst 2 år räknat från respektive ombalanseringsdag till förfallodagen. För obligationer som redan ingår i indexet är den minsta återstående löptiden 1 år vid varje månatlig ombalansering.
- Alla obligationer kräver ett utestående minimibelopp på 300 miljoner euro för att få ingå i indexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Markit.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXLHYT

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid).

Vid indexberäkningen används mittkurser. Nya värdepapper som införs i indexet, införs i indexet till respektive säljkurser. Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Markit-index finns på www.markit.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Replikering av samplingsindex
Hög avkastning	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,33 %	0,07 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Det index som refereras häri tillhör Markit Indices Limited. (”**indexsponsorn**”) och har licensierats för användning i anknytning till delfonden. Vardera part bekräftar och är överens om att delfonden inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexsponsorn. Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, vare sig uttryckliga eller underförstådda, och friskriver sig härmed uttryckligen från alla garantier (inbegripet, utan begränsning, sådana som rör säljbarhet eller lämplighet för ett visst syfte eller användningsområde) beträffande indexet och alla däri ingående eller relaterade data, och friskriver sig särskilt från alla garantier beträffande kvalitet, riktighet och/eller fullständighet rörande indexet eller däri ingående data, de resultat som erhålls till följd av användning av indexet och/eller indexets sammansättning vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars och/eller någon enhets kreditvärdighet, eller sannolikheten för en kredithändelse eller liknande händelse (oavsett definition) som avser en förpliktelse, i indexet vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars. Indexsponsorn ska inte hållas ansvarig (vare sig på grund av oaktsamhet eller annat) gentemot parterna eller någon annan person för eventuella fel i indexet och har ingen skyldighet att meddela parterna eller någon person om fel däri.
Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja delfonden, indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill eller risktagning i samband med det. Indexsponsorn har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer delfonden eller indexsponsorn har något ansvar gentemot någon part för indexsponsorns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexsponsorn och dess närstående företag får handla med alla obligationer som ingår i indexet och får, där så är tillåtet, ta emot insättningar från, utfärda lån eller på annat sätt bevilja krediter till och i allmänhet bedriva all slags affärs- eller investeringsbanksverksamhet eller annan verksamhet med sådana obligationers emittenter eller deras närstående företag och får då handla som om indexet inte existerade, oavsett om sådana handlingar inverkar negativt på indexet eller delfonden.

Amundi EUR Short Term High Yield Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med kreditbetyget BB/B emitterade av företagsemittenter som följer reglerna i iBoxx EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index (”**moderindexet**”) och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Indexets godtagbara investeringsområde omfattar alla värdepapper som utgör moderindexet, och det består av obligationer denominerade i euro som emitterats av offentliga eller privata emittenter med följande godtagbarhetskriterier:

- Endast skuldebrev denominerade i euro från emittenter är godtagbara, oberoende av risk eller ursprung.
- Alla obligationer måste ha ett genomsnittligt kreditbetyg på BB eller B. Det genomsnittliga kreditbetyget beräknas av iBoxx, baserat på de kreditbetyg som tillhandahålls av de tre kreditvärderingsinstituten: Fitch Ratings, Moody's Investors Service eller S&P Global Ratings.
- För att kvalificera sig för indexet måste alla godtagbara obligationer ha en återstående löptid på minst 2 år räknat från respektive ombalanseringsdag till förfallodagen. För obligationer som redan ingår i indexet är den minsta återstående löptiden 1 år vid varje månatlig ombalansering. Alla obligationer måste på ombalanseringsdagen ha en återstående löptid på mellan ett och tre år.
- Alla obligationer kräver ett utestående minimibelopp på 300 miljoner euro för att kunna omfattas av indexet.

Indexet väljer sedan bort beståndsdelar i moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Markit.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXME1T Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Markit-index finns på www.markit.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk

1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Hög avkastning	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Replikering av samplingsindex
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,20 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Det index som refereras häri tillhör Markit Indices Limited. (”**indexsponsorn**”) och har licensierats för användning i anknytning till delfonden. Vardera part bekräftar och är överens om att delfonden inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexsponsorn. Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, vare sig uttryckliga eller underförstådda, och friskriver sig härmed uttryckligen från alla garantier (inbegripet, utan begränsning, sådana som rör säljbarhet eller lämplighet för ett visst syfte eller användningsområde) beträffande indexet och alla däri ingående eller relaterade data, och friskriver sig särskilt från alla garantier beträffande kvalitet, riktighet och/eller fullständighet rörande indexet eller däri ingående data, de resultat som erhålls till följd av användning av indexet och/eller indexets sammansättning vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars och/eller någon enhets kreditvärdighet, eller sannolikheten för en kredithändelse eller liknande händelse (oavsett definition) som avser en förpliktelse, i indexet vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars. Indexsponsorn ska inte hållas ansvarig (vare sig på grund av oaktsamhet eller annat) gentemot parterna eller någon annan person för eventuella fel i indexet och har ingen skyldighet att meddela parterna eller någon person om fel däri.

Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja delfonden, indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill eller risktagning i samband med det. Indexsponsorn har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer delfonden eller indexsponsorn har något ansvar gentemot någon part för indexsponsorns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexsponsorn och dess närstående företag får handla med alla obligationer som ingår i indexet och får, där så är tillåtet, ta emot insättningar från, utfärda lån eller på annat sätt bevilja krediter till och i allmänhet bedriva all slags affärs- eller investeringsbanksverksamhet eller annan verksamhet med sådana obligationers emittenter eller deras närstående företag och får då handla som om indexet inte existerade, oavsett om sådana handlingar inverkar negativt på indexet eller delfonden.

Amundi EUR Floating Rate Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett obligationsindex som är representativt för investment grade-obligationer denominerade i euro, som är emitterade av emittenter från industriländer som följer reglerna i iBoxx EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”**moderindexet**”) och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Indexets godtagbara investeringsområde omfattar alla värdepapper som utgör moderindexet, och det består av obligationer denominerade i euro emitterade av emittenter från industriländer med följande godtagbarhetskriterier:

- Alla obligationer måste ha ett genomsnittligt kreditbetyg som motsvarar investment grade. Det genomsnittliga kreditbetyget beräknas av iBoxx, baserat på de kreditbetyg som tillhandahålls av tre kreditvärderingsinstitut: Fitch Ratings, Moody's Investors Service eller S&P Global Ratings. Investment grade definieras som BBB- eller högre från Fitch Ratings och S&P Global Ratings och Baa3 eller högre från Moody’s Investor Service.
- Alla godtagbara obligationer måste ha en återstående löptid på minst 1 månad räknat från respektive ombalanseringsdag till förfallodagen.
- Alla obligationer kräver ett utestående minimibelopp på 300 miljoner euro för att få ingå i indexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Markit.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXFRNT

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid). Vid indexberäkningen används mittkurser. Nya värdepapper som införs i indexet, införs i indexet till respektive säljkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Markit-index finns på markit.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk

1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Replikering av samplingsindex

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %
UCITS ETF GBP Hedged Acc	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,07 %
UCITS ETF USD HEDGED Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Det index som refereras häri tillhör Markit Indices Limited. (”**indexsponsorn**”) och har licensierats för användning i anknytning till delfonden. Vardera part bekräftar och är överens om att delfonden inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexsponsorn. Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, vare sig uttryckliga eller underförstådda, och friskriver sig härmed uttryckligen från alla garantier (inbegripet, utan begränsning, sådana som rör säljbarhet eller lämplighet för ett visst syfte eller användningsområde) beträffande indexet och alla däri ingående eller relaterade data, och friskriver sig särskilt från alla garantier beträffande kvalitet, riktighet och/eller fullständighet rörande indexet eller däri ingående data, de resultat som erhålls till följd av användning av indexet och/eller indexets sammansättning vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars och/eller någon enhets kreditvärdighet, eller sannolikheten för en kredithändelse eller liknande händelse (oavsett definition) som avser en förpliktelse, i indexet vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars. Indexsponsorn ska inte hållas ansvarig (vare sig på grund av oaktsamhet eller annat) gentemot parterna eller någon annan person för eventuella fel i indexet och har ingen skyldighet att meddela parterna eller någon person om fel däri.

Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja delfonden, indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill eller risktagning i samband med det. Indexsponsorn har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer delfonden eller indexsponsorn har något ansvar gentemot någon part för indexsponsorns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexsponsorn och dess närstående företag får handla med alla obligationer som ingår i indexet och får, där så är tillåtet, ta emot insättningar från, utfärda lån eller på annat sätt bevilja krediter till och i allmänhet bedriva all slags affärs- eller investeringsbanksverksamhet eller annan verksamhet med sådana obligationers emittenter eller deras närstående företag och får då handla som om indexet inte existerade, oavsett om sådana handlingar inverkar negativt på indexet eller delfonden.

Amundi USD Floating Rate Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet är ett obligationsindex som är representativt för investment grade-obligationer denominerade i US-dollar, som är emitterade av emittenter från industriländer som följer reglerna i iBoxx USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”**moderindexet**”) och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

US-dollar

Indexets sammansättning

Indexets godtagbara investeringsområde omfattar alla värdepapper som utgör moderindexet, och det består av obligationer denominerade i euro emitterade av emittenter från industriländer med följande godtagbarhetskriterier:

- Alla obligationer måste ha ett genomsnittligt kreditbetyg som motsvarar investment grade. Det genomsnittliga kreditbetyget beräknas av iBoxx, baserat på de kreditbetyg som tillhandahålls av tre kreditvärderingsinstitut: Fitch Ratings, Moody's Investors Service eller S&P Global Ratings. Investment grade definieras som BBB- eller högre från Fitch Ratings och S&P Global Ratings och Baa3 eller högre från Moody’s Investor Service.
- Alla godtagbara obligationer måste ha en återstående löptid på minst 1 månad räknat från respektive ombalanseringsdag till förfallodagen.
- Alla obligationer kräver ett utestående minimibelopp på 300 miljoner euro för att få ingå i indexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Markit.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXFRN3

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.00 (New York-tid).

Vid indexberäkningen används mittkurser. Nya värdepapper som införs i indexet, införs i indexet till respektive säljkurser. Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Markit-index finns på www.markit.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk

1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %
UCITS ETF MXN Hedged Acc	MXN	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Det index som refereras häri tillhör Markit Indices Limited. (”indexsponsorn”) och har licensierats för användning i anknytning till delfonden. Vardera part bekräftar och är överens om att delfonden inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexsponsorn. Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, vare sig uttryckliga eller underförstådda, och friskriver sig härmed uttryckligen från alla garantier (inbegripet, utan begränsning, sådana som rör säljbarhet eller lämplighet för ett visst syfte eller användningsområde) beträffande indexet och alla däri ingående eller relaterade data, och friskriver sig särskilt från alla garantier beträffande kvalitet, riktighet och/eller fullständighet rörande indexet eller däri ingående data, de resultat som erhålls till följd av användning av indexet och/eller indexets sammansättning vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars och/eller någon enhets kreditvärdighet, eller sannolikheten för en kredithändelse eller liknande händelse (oavsett definition) som avser en förpliktelse, i indexet vid någon viss tidpunkt på något visst datum eller annars. Indexsponsorn ska inte hållas ansvarig (vare sig på grund av oaktsamhet eller annat) gentemot parterna eller någon annan person för eventuella fel i indexet och har ingen skyldighet att meddela parterna eller någon person om fel däri.

Indexsponsorn gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja delfonden, indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill eller risktagning i samband med det. Indexsponsorn har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer delfonden eller indexsponsorn har något ansvar gentemot någon part för indexsponsorns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexsponsorn och dess närstående företag får handla med alla obligationer som ingår i indexet och får, där så är tillåtet, ta emot insättningar från, utfärda lån eller på annat sätt bevilja krediter till och i allmänhet bedriva all slags affärs- eller investeringsbanksverksamhet eller annan verksamhet med sådana obligationers emittenter eller deras närstående företag och får då handla som om indexet inte existerade, oavsett om sådana handlingar inverkar negativt på indexet eller delfonden.

Amundi Global High Yield Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Corporate High Yield Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet ger exponering mot företagsobligationsmarknaden med hög avkastning denominerad i USD, EUR och GBP.

Indexet är baserat på Bloomberg Global High Yield Corporate Index (”**moderindex**”) och använder ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet består av obligationer med hög avkastning som är denominerade i USD, EUR och GBP som emitteras av företag på utvecklade marknader och ett lägsta utestående nominellt belopp med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I35333US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning

Derivat
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
Hög avkastning
Indexreplikering
Räntesats
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
Marknad
Hållbara investeringar
Användning av tekniker och instrument
Replikering av samplingsindex

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart
Operativ
Standard
Likviditet
Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 3 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på medellång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14.00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut
Transaktionsdag +1
tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DR – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF DR - HEDGED EUR	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,20 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi USD Emerging Markets Government Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för J.P. Morgan EMBI Global Diversified Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet har som mål att följa resultatet för likvida obligationer noterade i USD från tillväxtmarknader med
statliga och halvstatliga emittenter.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet inkluderar värdepapper med höga kreditbetyg, hög avkastning och utan betyg i form av statsobligationer och halvstatliga obligationer med minst 1 miljard dollar i totalt utestående belopp. Ett likviditetsfilter tillämpas för att endast inkludera instrument från länder med minsta totala belopp på 2 miljarder dollar. Därefter tillämpas en diversifieringsmetod, som begränsar viktningen för de större indexländerna genom att bara inkludera en angiven del av dessa länders aktuella totala belopp i utestående skuld.
Endast instrument noterade i USD är kvalificerade. Instrument där kupongen eller inlösningsbeloppet är kopplat till en valutakurs kvalificeras inte för inkludering. Obligationer med fast eller rörlig ränta, som är kapitaliserande eller amorterande, är kvalificerade.
Länder som är kvalificerade för en inkludering i indexet måste följa vissa regler i indexmetoden, framför allt baserat på parametrar som bruttonationalinkomst och landets levnadskostnader. Mer information finns i indexmetoden.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av J.P. Morgan.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: JPEITRUS
Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.00 (New York-tid).
Vid indexberäkningen används mittkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i J.P. Morgan-indexet finns på www.jpmorgan.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad
Hög avkastning	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,23 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI ASSET MANAGEMENTS AMUNDI USD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV J.P. MORGAN OCH J.P. MORGAN GÖR INGA UTFÄSTELSER OM LÄMPLIGHETEN ATT INVESTERA I AMUNDIS AMUNDI USD EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND. J.P. MORGAN GARANTERAR INTE FULLSTÄNDIGHETEN ELLER RIKTIGHETEN FÖR J.P. MORGAN EMBI GLOBAL DIVERSIFIED SELECT INDEX. ”J.P. MORGAN” ÄR ETT REGISTRERAT TJÄNSTEMÄRKE TILLHÖRANDE JPMORGAN CHASE & CO. © 2025. JPMORGAN CHASE & CO. MED ENSAMRÄTT.

Amundi Global Inflation-Linked Bond Select[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Year Tilted Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som motsvarar inflationsindexerade statsobligationer som är noterade i lokal valuta med höga kreditbetyg emitterade på en av 11 olika utvecklade marknader – Australien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA – som ger högre vikt till emittenter med högre JSTAR-betyg (J.P. Morgan Screened, Tilted and Reweighted) och lägre vikt till emittenter med lägre betyg.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet består av internationella inflationsindexerade obligationer av med högt kreditbetyg utgivna i lokal valuta av staten i tolv industriländer, nämligen Australien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA med en återstående löptid mellan 1 och 10 år.

Indexet tillämpar JSTAR-emittentbetyg* (J.P. Morgan Screened, Tilted and Reweighted) för att justera vikterna för indexets komponenter jämfört med respektive basindex. JSTAR-indexvärdet är en sammanslagning av Verisk Maplecroft och Sustainalytics på lika vikt. Betygen varierar från 0 – 100, där 100 är som bästa möjliga betyg.

JSTAR-betygen indelas i band som används för att skala varje emissions marknadsvärde för basindex. JSTAR-banden balanseras om kvartalsvis, vid ombalanseringen i månadsslutet av januari, april, juli och oktober.

Indexet viktas med börsvärde som är beroende av viktning baserat på JSTAR-betyg; absolut skillnad mellan vikt i indexet och vikt baserad på börsvärde får inte överstiga 5 %.

Utöver den maximala förändringen på 5 % med avseende på vikter baserade på börsvärde får varje lands vikt på grund av viktning baserad på JSTAR-betyg inte överstiga 2,1 gånger sin marknadsvärdesbaserade viktning. Viktningen ändras varje månad på ombalanseringsdagen vid månadsslutet och viktningen förblir aktiv under resten av den månaden.

* Läs om indexmetoden på www.jpmorgan.com för mer information om betyg, urval och band.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av J.P. Morgan.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: JPILGLTL

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i J.P. Morgan-indexet finns på www.jpmorgan.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.
Delfonden innehar inga värdepapper i företag som verkar inom produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad

[1] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IU	USD	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,04 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

FÖRVALTNINGSBOLAGET, INVESTERINGSFÖRVALTAREN OCH DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV J.P. MORGAN OCH J.P. MORGAN GÖR INGA UTFÄSTELSER OM LÄMPLIGHETEN ATT INVESTERA I INDEXET. J.P. MORGAN GARANTERAR INTE FULLSTÄNDIGHETEN ELLER RIKTIGHETEN FÖR INDEXET. ”J.P. MORGAN” ÄR ETT REGISTRERAT TJÄNSTEMÄRKE TILLHÖRANDE JPMORGAN CHASE & CO. © 2016. JPMORGAN CHASE & CO. MED ENSAMRÄTT.

Amundi Euro Government Bond 25+Y[5]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet erbjuder exponering mot räntebärande offentliga obligationer med höga kreditbetyg emitterade av suveräna stater som ingår i EMU. Detta index innehåller endast obligationer denominerade i euro med en löptid över tjugofem år.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet omfattar obligationer med följande urvalskriterier:
- Minsta utestående belopp på 1 miljard EUR.
- Länder måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre) för att tas med i indexet.
- Minst 25 år återstår till den slutliga förfallodagen.
- Endast statsobligationer.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I35202EU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

---

5 Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF USD HEDGED Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,04 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Euro Government Tilted Green Bond[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är baserat på Euro Treasury 50bn Bond Index (”**moderindexet**”) och mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta denominerade i euro.

Indexet har en inriktning så att minst 30 % av indexets marknadsvärde på en ombalanseringsdag är allokerat till värdepapper som klassificeras som gröna obligationer och resterande procentandel är allokerad till icke-gröna obligationer, och riskprofilerna för indexet och moderindexet är jämförbara.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning

Indexet uppfyller följande kriterier:

- Godtagbara obligationer har ett utestående nominellt belopp på minst 1 miljard euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro vid indexets startdatum.
- Länder måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre) för att tas med i indexet enligt medelbetyget från Moody’s, S&P och Fitch.
- Den återstående löptiden måste vara minst ett år, oavsett optionalitet.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.
- Indexet ombalanseras varje månad. Före slutet av månaden bestäms indexsammansättningen för följande månad baserat på moderindexets värden för att fastställa den totala vikten av gröna obligationer till minst 30 % och upprätthålla en jämförbar riskprofil med moderindexet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
Alla obligationer som kvalificerar sig för index prissätts av Bloombergs utvärderande prissättningstjänst, BVAL. Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.15 (Londontid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

På prospektets datum används följande kortnamn: I37637EU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

[1] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Replikering av samplingsindex

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Euro Government Bond Highest Rated Investment Grade[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som representerar statsobligationer utfärdade av euroområdets medlemsländer med längre återstående löptid än 1 år och med minst två betyg lika med AAA eller motsvarande från de tre kreditvärderingsinstituten S&P, Moody’s och Fitch.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet innehåller minst fem emittenter. Om en emittent nedgraderas ska emittenten endast ersättas om en annan emittent i sin tur blir kvalificerad, för att på så sätt uppfylla det minsta antal emittenter som krävs för indexet. Med andra ord är värdepapperen de högst värderade räntebärande värdepapperen i euroområdets suveräna stater.

Kvalificeringskriterierna för de obligationer som utgör indexet är följande:
- nominellt värde och kuponger denominerade i euro, utan optioner och utan konvertibilitet
- handlas på MTS-plattformen (elektronisk plattform för notering och handel med obligationer i euro som täcker hela Europa)
- utfärdad av en suverän stat i ett av de euroländer som anges i indexleverantörens metod
- återstående löptid på över ett år
- emitterade till ett totalbelopp på minst 2 miljarder euro.

Viktning för varje indexkomponent baseras på dess marknadsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: EM3AG5

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid). Kurser som används vid indexberäkningen är köpkurser. Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Replikering av samplingsindex
Räntesats	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

[1] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond[8]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer i medlemsländer i euroområdet (enligt definitionen av indexleverantörens metod) med lägre kreditvärdighet jämfört med de som utfärdats av andra stater inom euroområdet.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet omfattar obligationer med följande urvalskriterier:
- nominellt värde och kuponger denominerade i euro, utan optioner och utan konvertibilitet
- handlas på MTS-plattformen (elektronisk plattform för notering och handel med obligationer i euro som täcker hela Europa)
- utfärdade av en suverän stat bland de euroländer som anges i indexleverantörens metod
- löptid på över ett år
- minst två betyg under ”AAA” eller ett betyg under motsvarigheten till AAA-betyget från ett av kreditvärderingsinstituten S&P, Moody’s och Fitch
- minst två höga kreditbetyg, också från kreditvärderingsinstituten S&P, Moody’s och Fitch, dvs. högre eller lika med BBB- från S&P och Fitch och Baa3 från Moody’s
- emitterade till ett totalbelopp på minst 2 miljarder euro
- emittenter som inte ingår i FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index (som omfattar länder med betyget ”AAA” av minst två av de ovan nämnda kreditvärderingsinstitut eller länder som kanske inte längre uppfyller kreditbetygskriterierna, men som trots detta fortfarande ingår i indexet enligt kriteriet att minst fem länder ska ingå)
- den totala viktningen för varje emittent är begränsad till 30 %.

Viktning för varje indexkomponent baseras på dess marknadsvärde. Om antalet länder understiger 4 är länderna lika viktade.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: EMTSIG5

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Replikering av samplingsindex
Räntesats	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument

8 Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond 1-3Y[9]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG 1-3Y Index ("**indexet**") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer från medlemsländer i euroområdet (enligt definitionen i indexmetoden) med en löptid på mellan 1 och 3 år och med lägre kreditvärdighet jämfört med de som utfärdats av andra stater inom euroområdet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet omfattar obligationer med följande urvalskriterier:

- nominellt värde och kuponger denominerade i euro, utan optioner och utan konvertibilitet
- handlas på MTS-plattformen (elektronisk plattform för notering och handel med obligationer i euro som täcker hela Europa)
- utfärdade av en suverän stat bland de euroländer som anges i indexleverantörens metod
- löptid från 1 till 3 år
- har minst två betyg under "AAA"-betyg eller motsvarande ett AAA-betyg från ett eller flera av kreditvärderingsinstituten S&P, Moody's och Fitch, dvs. högre eller lika med BBB- från S&P och Fitch, och Baa3 från Moody's
- har minst två investment grade-kreditbetyg, också från S&P, Moody's och Fitch
- emitterade till ett totalbelopp på minst 2 miljarder euro
- emittenter som inte ingår i FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond 1-3Y Index
- emittenter som inte ingår i FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index (som omfattar länder med betyget "AAA" av minst två av de ovan nämnda kreditvärderingsinstitut eller länder som kanske inte längre uppfyller kreditbetygskriterierna, men som trots detta fortfarande ingår i indexet enligt kriteriet att minst fem länder ska ingå)
- den totala viktningen för varje emittent är begränsad till 30 %.

Viktning för varje indexkomponent baseras på dess marknadsvärde. Om antalet länder understiger 4 är länderna lika viktade.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE ("**FTSE**").

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: EMTSIA5

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten "Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering" och "Replikeringsmetoder" i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Derivat	Förvaltning
Indexreplikering	Marknad
Investeringsfond	Hållbarhet
Räntesats	Användning av tekniker
Kredit	och instrument

9 Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 1,5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på kort till medellång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Italy BTP Government Bond 1-3Y[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Eurozone Italy Government 1-3Y (Mid Price) Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Jämförelseindexet är FTSE Eurozone Italy Government 1-3Y (Mid Price) Index, denominerat i euro. Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet består av italienska statsobligationer med löptider på ett till tre år. De ursprungliga indexkomponenterna valdes med samma kriterier som de som användes för de andra FTSE-statsobligationsindexen, som beskrivs nedan.
För att kvalificera sig för jämförelseindexet måste obligationer uppfylla följande kriterier:

- Nominella obligationer, med fasta kuponger, som kan lösas in på förfallodagen i lokal valuta, utan inbäddade optioner och icke-konvertibla.
- Handlas på MTS-plattformen.
- Emitterade av den italienska regeringen.
- Har en minsta utestående emission på två miljarder euro (per den 31 maj 2022).

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: FMMPITA5

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Ränta	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 3 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på medellång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

[1] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Italy BTP Government Bond 10Y[11]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Eurozone Target Maturity Government Bond Italy (Mid Price) Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är FTSE Target Maturity Government Bond Italy (Mid Price) Index denominerat i euro.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet består av italienska statsobligationer med en genomsnittlig återstående löptid på tio år. De ursprungliga indexkomponenterna valdes med samma kriterier som de som användes för de andra FTSE-statsobligationsindexen, som beskrivs nedan.
För att kvalificera sig för jämförelseindexet måste obligationer uppfylla följande kriterier:

- Nominella obligationer, med fasta kuponger, som kan lösas in på förfallodagen i lokal valuta, utan inbäddade optioner och icke-konvertibla.
- Handlas på MTS-plattformen.
- Emitterade av den italienska regeringen.
- Har en minsta utestående emission på två miljarder euro (per den 31 maj 2022).

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: FMMPITX5

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Ränta	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 3 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på medellång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 15.30 CET på relevant transaktionsdag.

[11] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Core EUR Corporate Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Euro Corporate Bond Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett brett jämförelseindex som mäter marknaden för företagsobligationer med fast ränta som har höga kreditbetyg och är noterade i euro. Obligationer tas med i indexet på grundval av noteringsvalutan, inte emittentens riskland.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexkomponenterna är representativa för företagsobligationer med fast ränta, som är noterade i euro och har högt kreditbetyg.

Emittenterna kan ha sitt säte utanför Europa, och endast obligationens valuta, kreditbetyg, storlek och löptid beräknas in för urvalet i indexet.

Lägsta löptid för varje obligation är minst ett år fram till den slutliga förfallodagen.

Det lägsta utestående beloppet per emission är 300 miljoner euro. Både högre och lägre prioriterade emissioner ingår.
Obligationerna viktas enligt marknadsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: LECPTREU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid).
Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbarhet
Ränta	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Prime Euro Government Bond 0-1Y

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Solactive Eurozone Government Bond 0-1 Year Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet avser att följa utvecklingen för statsobligationer och statsskuldväxlar noterade i euro med en återstående löptid på mellan en månad och ett år.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
I indexet ingår obligationer och växlar som emitterats av nationella regeringar från länder i euroområdet och som har höga kreditbetyg från antingen Moody’s Investors Service eller S&P Ratings. För att förtydliga får ett land tas med i indexet om ett av de båda instituten ger landet ett högt kreditbetyg.

För att få ingå i indexet måste alla instrument vara noterade i euro, ha ett lägsta utestående belopp på 1,5 miljarder euro och en effektiv återstående löptid på högst ett år. Endast instrument med fast kupong och nollkupong får ingå i indexet. Det emitterande landet måste ha ett sammanlagt utestående belopp i godtagbara instrument på minst 5 miljarder euro.

Varje indexkomponent viktas enligt sitt marknadsvärde. Dessutom har varje emitterande lands vikt ett tak för börsvärde på 25 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SOLEUS01
Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid).
Vid indexberäkningen används köpkurser. Obligationer som läggs till i en ombalansering tas med i indexet till säljkursen på den aktuella ombalanseringsdagen.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.

Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Marknad
Förvaltning	
Räntesats	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 1 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på kort sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %
IE Acc	EUR	USD 500 000	3,50 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Prime Euro Government Bond[12]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Solactive Eurozone Government Bond Index(”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex, som är representativt för inhemska statsobligationer som är emitterade av länder i euroområdet och som har ett högt kreditbetyg från ett kreditvärderingsinstitut (Standard & Poors eller Moody’s).
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexkomponenterna är representativa för inhemska statsobligationer som är emitterade av länder i euroområdet och som har ett högt kreditbetyg från ett kreditvärderingsinstitut (Standard & Poors eller Moody’s), dvs. obligationernas betyg måste vara lika med eller högre än BBB- för Standard & Poors eller Baa3 för Moody’s.
För att vara godtagbara för indexet måste obligationerna vara utfärdade i euro, ha en fast kupong, en minsta återstående löptid på 1 år och ett minsta utestående belopp på 1,5 miljarder euro.
Obligationerna viktas enligt marknadsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SOLEUSOV
Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paristid).
Vid indexberäkningen används köpkurser.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Räntesats	
Kredit	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

[12] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %
IE Acc	EUR	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Prime Global Government Bond[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Solactive Global Developed Government Bond Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som inkluderar statsobligationer med fast ränta från de viktigaste industriländerna med hög kreditvärdighet.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning

För att inkluderas i indexet måste landet ha ett högt kreditbetyg från ett kreditvärderingsinstitut (Standard & Poors eller Moody’s), dvs. kreditbetyget för landets obligationer måste vara lika med eller högre än BBB- för Standard & Poors eller Baa3 för Moody’s, och det totala marknadsvärdet för obligationerna, emitterade i lokal valuta, måste vara högre än 1 % av det totala marknadsvärdet för det kvalificerade investeringsområdet för obligationerna.
Det kvalificerade investeringsområdet består av obligationer som är emitterade av industriländer, emittenter med högt kreditbetyg, i lokal valuta, med en återstående löptid på över ett år, och vars utestående belopp är större än 1,5 miljarder i dess lokala valuta, Japan undantaget, där det lägsta beloppet är 150 miljarder JPY, Danmark där det lägsta beloppet är 15 miljarder DKK och Sverige där det lägsta beloppet är 15 miljarder SEK.

Det utestående beloppet för varje obligation justeras av innehavet i centralbanken i varje land, när uppgifterna är offentliga.

Skuldebrev viktas i indexet enligt deras marknadsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: SOLGDGA

Indexets resultat som fastställs vid stängningstid på de lokala marknader som utgör indexet. Vid indexberäkningen används köpkurser.
Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på www.solactive.de

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbarhet
Ränta	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

[1] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DET FINANSIELLA INSTRUMENTET SPONSRAS, MARKNADSFÖRS, SÄLJS ELLER STÖDS INTE PÅ NÅGOT ANNAT SÄTT AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG ERBJUDER INTE HELLER NÅGON UTTRYCKLIG ELLER IMPLICIT GARANTI ELLER FÖRSÄKRAN, VARE SIG MED AVSEENDE PÅ RESULTATEN AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET OCH/ELLER INDEXETS VARUMÄRKE ELLER INDEXPRISET VID NÅGOT TILLFÄLLE ELLER I NÅGOT ANNAT AVSEENDE. INDEXET BERÄKNAS OCH PUBLICERAS AV SOLACTIVE AG. SOLACTIVE AG GÖR SITT BÄSTA FÖR ATT SE TILL ATT INDEXET BERÄKNAS KORREKT. OAKTAT SINA SKYLDIGHETER GENTEMOT EMITTENTEN HAR SOLACTIVE AG INGEN SKYLDIGHET ATT PÅPEKA FEL I INDEXET TILL TREDJE PART, INKLUSIVE MEN INTE BEGRÄNSAT TILL INVESTERARE OCH/ELLER FINANSIELLA MELLANHÄNDER FÖR DET FINANSIELLA INSTRUMENTET. VARKEN SOLACTIVE AG:S OFFENTLIGGÖRANDE AV INDEXET ELLER LICENSIERING AV INDEXET ELLER INDEXETS VARUMÄRKE FÖR ANVÄNDNING I SAMBAND MED DET FINANSIELLA INSTRUMENTET UTGÖR EN REKOMMENDATION FRÅN SOLACTIVE AG ATT INVESTERA KAPITAL I NÄMNDA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

Amundi Core USD Corporate Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg US Corporate Liquid Issuer Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som mäter den likvidare underuppsättningen av Bloomberg US Corporate Index, som följer marknaden för beskattningsbara företagsobligationer med höga kreditbetyg och fast ränta och inkluderar värdepapper som är denominerade i US-dollar och som emitterats offentligt av amerikanska och icke-amerikanska emittenter inom industri, allmännyttiga företag och finans (”**moderindexet**”).
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet. Följande kriterier tillämpas sedan för att vara godtagbara för indexet:
– Obligationer måste ha en återstående löptid på minst tre år och ett lägsta utestående nominellt belopp på 750 miljoner US-dollar för att vara godtagbara för indexet.
– Dessutom måste emittenterna ha ett lägsta utestående nominellt belopp på 2 miljarder US-dollar i moderindexet för att tas med.
– Emittenter från riskländer på tillväxtmarknader utesluts i enlighet med Bloomberg-indexets definition.

Emittenter är även begränsade till 3 % av marknadsvärdet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I38697US

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.00 (New York-tid).

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbarhet
Ränta	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,03 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,06 %	0,03 %
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,03 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Core US Treasury Bond[14]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg U.S. Treasury Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet mäter nominella skuldförbindelser med fast ränta denominerade i US-dollar och emitterade av det amerikanska finansdepartementet. Statsobligationer är uteslutna genom löptidsbegränsningen. STRIPS är uteslutna från indexet eftersom inkludering skulle leda till dubbelräkning. Obligationerna måste ha en återstående löptid på minst ett år.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet omfattar obligationer med följande urvalskriterier:
- Amerikanska statsobligationer
- Amorteringsfria, säljbara, inlösningsbara obligationer och amorteringsobligationer
- Nollkupongare vid den ursprungliga emissionen

Indexet utesluter obligationer med följande urvalskriterier:
- Inflationsindexerade obligationer, obligationer med rörlig ränta
- STRIPS, statsskuldväxlar
- Obligationer för delstatliga och lokala myndigheter (SLGS)

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: LUATTRUU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.00 (New York-tid).

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Ränta	Användning av tekniker och Instrument
Investeringsfond Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

[14] Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi US Treasury Bond 0-1Y

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg US Short Treasury Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer, växlar och skuldförbindelser som är denominerade i USD och emitterade av den amerikanska staten. I indexet ingår statsskuldväxlar emitterade med fast löptid på 4, 13, 26 och 52 veckor samt statsskuldväxlar och obligationer med återstående löptid under ett år.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning

Indexet omfattar värdepapper med följande kvalificeringskriterier:

- Endast amerikanska finansdepartementets statsskuldsväxlar, skuldförbindelser och obligationer är godtagbara.
- Statsskuldsväxlar, skuldförbindelser och obligationer noterade i USD.
- Minsta återstående löptid på mer än 1 månad på ett ombalanseringsdatum.
- Högsta återstående löptid på 1 år eller mindre på ett ombalanseringsdatum.
- Värdepapper måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre).
- Viktning för varje indexkomponent baseras på dess marknadsvärde.
- Amerikanska statspapper som hålls på Federal Reserve SOMA-kontot (både köp vid emittering och netto från sekundära marknadstransaktioner) dras av från det totala utestående beloppet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: LT12TRUU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.

Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Ränta	Användning av tekniker och instrument
Investeringsfond	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
	Säkringsrisk (säkrad andelsklass)

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 1 år.

- är intresserade av investeringstillväxt på kort sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Delfonden kan tilltala investerare som:

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,02 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Global Corporate IG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Global Corporate IG select Index(”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för globala skuldförbindelser med fast ränta med höga kreditbetyg, emitterade av företag på utvecklade marknader inom industri-, el-/vatten- och finanssektorerna och som är en del av OECD-länderna (Organisation for Economic Co-operation and Development).

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Värdepapperen som ingår i indexet har högt kreditbetyg (enligt medelbetyget från Moodys, S&P och Fitch) och har minst ett års återstående löptid. Indexet är ett jämförelseindex med flera valutor som omfattar företagsobligationer med fast ränta och ett lägsta utestående nominellt belopp med fasta minsta emissionsstorlekar för alla godtagbara valutor. Endast obligationer från OECD-valutor och OECD-länder väljs och obligationer från tillväxtmarknadernas valutor och länder utesluts. Listan över OECD-valutor och tillväxtmarknadsvalutor granskas årligen. För att vara godtagbara för indexet måste obligationer ha både ett OECD-riskland och ett OECD-land där de har sin hemvist. Emittenter från riskländer på tillväxtmarknader utesluts i enlighet med definitionen för Bloomberg EM Country.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I37936US
Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet, men den måste följa kreditbetyg och OECD-kriterier för att inneha värdepapper. Under en kort tidsperiod, upp till tre månader, kan undantag från dessa begränsningar göras i händelse av värdepapper som ingår i jämförelseindexet men nedgraderas från ett gott kreditbetyg.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet
Indexreplikering Ränta	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IU	USD	USD 500 000	2,50 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi FTSE EPRA NAREIT Global II

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE EPRA/NAREIT Developed Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för börsnoterade fastighetsföretag och fastighetsfonder i hela världen.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Alla aktier i indexet viktas enligt storleken på deras justerade fritt flytande börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: TRNGLE

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Fastighetsinvesteringar
Indexreplikering	Hållbarhet
Indirekt replikering	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.
Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.
Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,35 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi MSCI EMU Small Cap ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Custom Net EUR Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Small Cap Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper i små företag i utvecklade länder i Ekonomiska och monetära unionen (”EMU”). Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.
Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMSCCT
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 52 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Marknad
Aktieexponering	Aktier i små och medelstora företag
Indexreplikering	Hållbar investering
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	
Förvaltning	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för STOXX Europe Select Dividend 30 Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som representerar aktiemarknadsresultatet för de stora europeiska företag som betalar mest utdelning i sina respektive länder, samtidigt som volatiliteten i skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning minimeras.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet är baserat på STOXX 600 Index. Det mäter aktiemarknadsresultatet för de stora europeiska företag som ger mest utdelning i sina respektive länder. Det täcker ett område med 600 aktier i följande länder: Tyskland, Österrike, Belgien, Danmark, Spanien, Finland, Frankrike, Tjeckien Irland, Italien, Luxemburg, Norge, Nederländerna, Portugal, Storbritannien, Sverige och Schweiz. Varje aktie i indexet viktas enligt dess årliga nettoutdelningsförhållande så att de aktier som har den högsta utdelningsförhållandet får den högsta viktningen.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

STOXX:s officiella index beräknas utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SD3R

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Fastighetsinvesteringar
Indirekt replikering	Hållbarhet
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 17:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DIST	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,20 %	0,10 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,20 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi USD Corporate Bond Climate Paris Aligned

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI USD Corporate PAB Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är konstruerat utifrån Bloomberg US Corporate Index (”**moderindexet**”) och avser att vara representativt för marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg denominerade i US-dollar och samtidigt uppfylla och överträffa minimistandarderna i märkningen EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Indexet fastställer en initial 50 % minskning av koldioxidutsläppen från absoluta utsläpp av växthusgaser och koldioxidintensitet i förhållande till standardindexet Bloomberg US Corporate Index, följt av en årlig 7,35 % minskning av koldioxidutsläppen från båda åtgärderna, och använder en optimeringsmetod som syftar till att minimera den aktiva totala risken med avseende på det överordnade indexet under begränsningar.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar företagsobligationer (industriella, allmännyttiga och finansiella institutioner), prioriterade och efterställda obligationer med en återstående löptid på minst ett år till, oavsett optionalitet. Dessutom måste kapital och ränta vara denominerade i USD med ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner USD.
Sedan tillämpas filtren enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37953US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

- Valuta
- Derivat
- Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
- Indexreplikering Ränta
- Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
- Kredit
- Investeringsfond
- Förvaltning
- Marknad
- Replikering av samplingsindex
- Hållbara investeringar
- Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %
UCITS ETF EUR Hedged Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi USD High Yield Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG US Corporate High Yield Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet följer högavkastande företagsobligationer med fast ränta med ett utestående nominellt belopp på minst 300 miljoner US-dollar. Detta index är baserat på Bloomberg US Corporate High Yield Index (”**moderindex**”) och tillämpar ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.
Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet omfattar företagsobligationer (industriella, allmännyttiga och finansiella institutioner), prioriterade och efterställda obligationer med en återstående löptid på minst ett år till, oavsett optionalitet. Dessutom måste kapital och ränta vara denominerade i USD med ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner USD.
Sedan tillämpas filtren enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35279US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering Ränta	Replikering av samplingsindex
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Hållbara investeringar
Kredit	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 3 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på medellång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,20 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi EUR High Yield Corporate Bond ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate High Yield Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet följer högavkastande företagsobligationer med fast ränta med ett utestående nominellt belopp på minst 300 miljoner euro. Detta index är baserat på Bloomberg Euro Corporate High Yield Index (”**moderindex**”) och använder ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefininerade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet omfattar företagsobligationer (industriella, allmännyttiga och finansiella institutioner), prioriterade och efterställda obligationer med en återstående löptid på minst ett år till, oavsett optionalitet. I
Dessutom måste kapital och ränta vara denominerade i EUR med ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner EUR.
Sedan tillämpas filtren enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I35259EU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbar investering
Replikering av samplingsindex	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	
Räntesats	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Fixed Maturity 2027 Italy BTP Government Bond[15]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Italy Government 2027 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsland Italien med förfallodag 2027.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:

– Statsobligationer med fast ränta
– Godtagbara emitterande länder: Italien
– Kapitalbelopp och ränta måste vara denominerade i euro
– Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2027 och den 15 december 2027.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.

Listan över statsobligationer som ingår i indexet är statisk. Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och förblir fast till förfallodagen.

Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och indexets beståndsdelar förblir fasta till ett år före förfallodagen.

Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar).

Återstående tid till förfallodagen för varje statsskuldväxel är mellan en och sex månader per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIIT27

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNINGAV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Investeringsfond

[15] Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Derivat	Förvaltning
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Marknad
Indexreplikering	Replikering av samplingsindex
Koncentration	Hållbarhet
Räntesats	Användning av tekniker och instrum ent
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Fast förfallodag[16]
Kredit	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

[16] Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2027. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta innan investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året. Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året. Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Fixed Maturity 2027 German Bund Government Bond[17]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE German Government 2027 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsland Tyskland med förfallodag 2027.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:
– Statsobligationer med fast ränta
– Godtagbara emitterande länder: Tyskland
– Kapitalbelopp och ränta måste vara denominerade i euro
– Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2027 och den 15 december 2027.
Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.
Listan över statsobligationer som ingår i indexet är statisk.
Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och förblir fast till förfallodagen.
Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och indexets beståndsdelar förblir fasta till ett år före förfallodagen.
Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar). Varje statsskuldväxel har en till sex månaders återstående löptid till förfallodag per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIDE27

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

[17] Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Koncentration	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Kredit	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet
Indexreplikering	
Räntesats	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	
	Fast förfallodag[18]
	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

[18] Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2027. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta innan investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året. Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året. Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Fixed Maturity 2028 Euro Government Bond Broad[19]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Euro Broad Government 2028 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsländer med förfallodag 2028.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:

- Statsobligationer med fast ränta
- Godtagbara emitterande länder: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2028 och den 15 december 2028.

Listan över statsobligationer som ingår i indexet är statisk. Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och förblir fast till förfallodagen.
Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.

Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och indexets beståndsdelar förblir fasta till ett år före förfallodagen.

Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar). Varje statsskuldväxel har en till sex månaders återstående löptid till förfallodag per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIEB28

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Marknad
Valuta	Replikering av samplingsindex

[19] Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Derivat	Hållbarhet
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	Fast löptid[20] Förvaltning
Räntesats	
Investeringsfond	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

20 Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2028. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta innan investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året. Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året. Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND YIELD + [21]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Euro Yield+ Government 2028 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsländer med förfallodag 2028.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:

- Statsobligationer med fast ränta.
- Godtagbara emitterande länder: Italien, Portugal och Spanien.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2028 och den 15 december 2028.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.

Listan över statsobligationer som ingår i indexet är statisk. Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och förblir fast till förfallodagen.

Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och indexets beståndsdelar förblir fasta till ett år före förfallodagen.

Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar). Återstående tid till förfallodagen för varje statsskuldväxel är mellan en och sex månader per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIEY28

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

[21] Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Valuta
Indexreplikering	Derivat
Räntesats	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
	Fast förfallodag[22]

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

[22] Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2028. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta innan investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året. Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året.
Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF DIST	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Fixed Maturity 2026 Euro Government Bond Broad[23]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Euro Broad Government 2026 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsländer med förfallodag 2026.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:

- Statsobligationer med fast ränta
- Godtagbara emitterande länder: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2026 och den 15 december 2026.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.

Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och indexets beståndsdelar förblir fasta till ett år före förfallodagen.

Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar). Varje statsskuldväxel har en till sex månaders återstående löptid till förfallodag per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIEB26

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

[23] Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Koncentration	Investeringsfond
Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Fast förfallodag[24]
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 2 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet "Termer med specifika betydelser" för definitionerna av termerna "bankdag" och "transaktionsdag".

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade "UCITS ETF": 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade "UCITS ETF": 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**"T-NAV"**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

[24] Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2026. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta innan investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året. Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året.
Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

AMUNDI FIXED MATURITY 2027 EURO GOVERNMENT BOND BROAD[25]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Euro Broad Government 2027 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsländer med förfallodag 2027.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:
- Statsobligationer med fast ränta.
- Godtagbara emitterande länder: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2027 och den 15 december 2027.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.

Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och indexets beståndsdelar förblir fasta till ett år före förfallodagen.

Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar). Varje statsskuldväxel har en till sex månaders återstående löptid till förfallodag per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIEB27

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

[25] Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Koncentration	Investeringsfond
Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	Fast förfallodag[26]
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 3 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

[26] Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2027. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta innan investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året. Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året.
Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF DIST	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

AMUNDI FIXED MATURITY 2029 EURO GOVERNMENT BOND BROAD[27]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Euro Broad Government 2029 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsländer med förfallodag 2029.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:

- Statsobligationer med fast ränta.
- Godtagbara emitterande länder: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2029 och den 15 december 2029.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.

Det utestående beloppet för varje obligation fastställs vid start och indexets beståndsdelar förblir fasta till ett år före förfallodagen.

Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar). Varje statsskuldväxel har en till sex månaders återstående löptid till förfallodag per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:

- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIEB29

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

[27] Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Koncentration	Investeringsfond
Kredit	Förvaltning
Valuta	Marknad
Derivat	Replikering av
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	samplingsindex
	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	
	Fast förfallodag[28]

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (**”T-NAV”**) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

[28] Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2029. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta innan investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året. Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året.
Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF DIST	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi MSCI EM Asia ESG Broad Transition

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Net USD Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EM Asia Index (”**moderindexet**”), som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i länder med tillväxtmarknader i Asien. Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.
Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för klimatomställning finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEFAECT
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 52 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Tillväxtmarknader	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,15 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Global Corporate Bond 1-5Y Highest Rated ESG

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Corporate A+ 1-5 Year Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som består av företagsobligationer i flera valutor med höga kreditbetyg, fast ränta och en löptid mellan ett år och upp till, men inte inklusive fem år som använder sektor- och ESG-kriterier för säkerhetskvalificering.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.
Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till Parisavtalet om klimatförändringar (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Det tillämpliga investeringsområdet består av företagsobligationer med fast ränta på investment grade med mellan ett och upp till, men inte inklusive, fem år återstående löptid och med ett minsta utestående nominellt belopp med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor. Dessutom måste obligationer ha betyget A- eller högre från minst två kreditvärderingsinstitut (Moody's, s&P eller Fitch). Ytterligare ESG-kriterier beskrivs närmare i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I38487US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen eller företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller företag som är inblandade i kontroversiella branscher: tobak, termiskt kol, kärnvapen eller okonventionell olja och gas enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbara investeringar
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
	Standard

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF USD HEDGED Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,09 %	0,07 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Lifecycle 2030[29]

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2030 Screened Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet strävar efter att representera resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2030 (”**måldatumet för indexet**”).

Indexet består av godtagbara globala aktier från FTSE Developed Screened Select Index och räntebärande värdepapper denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, FTSE EMU Government Bond Select Index, FTSE EMU Government Green Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index.

I sin konstruktion beaktar indexet därtill faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Indexet är ett nettoavkastningsindex

–nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning
–kupongutbetalningarna från indexets beståndsdelar som är räntepapper ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet består av alla de värdepapper som omfattar fem följande underliggande index:

- FTSE Developed Screened Select Index är ett aktieindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör tre regioner, Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index är ett obligationsindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index – Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer som är representativt för statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE EMU Government Green Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som grön obligation av Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat, enligt beskrivningen i bilaga i, ESG-relaterade upplysningar

- FTSE EMU Government Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, är denominerade i euro samt emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

- FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och som är emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

Viktningen för varje underliggande index i indexet baseras på en förutbestämd glidande skala (enligt indexmetoden) som representerar förändringen av tillgångsklasser och underliggande index över tid fram till indexets måldatum.

År till indexets måldatum November 2030 (T)	FTSE Developed Screened Select Index	FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index	FTSE EMU Government Bond Select Index	FTSE EMU Government Green Bond Select Index	FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index
T-6.25	23 %	51 %	21 %	5 %	0 %
T-6	22 %	52 %	21 %	5 %	0 %
T-5	18 %	54 %	22 %	5 %	0 %
T-4	15 %	57 %	23 %	5 %	0 %
T-3	11 %	59 %	25 %	5 %	0 %
T-2	7 %	62 %	26 %	5 %	0 %
T-1	4 %	64 %	27 %	5 %	0 %
T-0	0 %	50 %	0 %	0 %	50 %
T+1	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %
T+2	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %
T+3	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %

Från indexets måldatum och enligt tabellen ovan kommer indexet gradvis att omfatta godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index.

[29] Denna beskrivning av delfonden kan justeras vid tidpunkten för måldatumet för att återspegla eventuella ändringar i placeringsinriktningen.

Delfonden kommer att avvecklas inom tre (3) år efter indexmåldatum efter föregående meddelanden till andelsägare. Andelsägarna i delfonden får därför sina andelar inlösta i enlighet med tidsplanen i ett sådant meddelande.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIILC30

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om ”hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 3 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på medellång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

AMUNDI LIFECYCLE 2033[30]

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2033 Screened Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet strävar efter att representera resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2033 (”**måldatumet för indexet**”).

Indexet består av godtagbara globala aktier från FTSE Developed Screened Select Index och räntebärande värdepapper denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, FTSE EMU Government Bond Select Index, FTSE EMU Government Green Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index.

I sin konstruktion beaktar indexet därtill faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Indexet är ett nettoavkastningsindex

–nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning
–kupongutbetalningarna från indexets beståndsdelar som är räntepapper ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet består av alla de värdepapper som omfattar fem följande underliggande index:

- FTSE Developed Screened Select Index är ett aktieindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör tre regioner, Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index är ett obligationsindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index – Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer som är representativt för statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE EMU Government Green Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som grön obligation av Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat, enligt beskrivningen i bilaga i, ESG-relaterade upplysningar

- FTSE EMU Government Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, är denominerade i euro samt emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

- FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och som är emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

Viktningen för varje underliggande index i indexet baseras på en förutbestämd glidande skala (enligt indexmetoden) som representerar förändringen av tillgångsklasser och underliggande index över tid fram till indexets måldatum.

Den glidande skalan är fördefinierat enligt indexmetoden och illustreras i tabellen nedan:

År till indexets måldatum November 2033 (T)	FTSE Developed Screened Select Index	FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index	FTSE EMU Government Bond Select Index	FTSE EMU Government Green Bond Select Index	FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index
T-9.25	34 %	44 %	17 %	5 %	0 %
T-9	33 %	45 %	17 %	5 %	0 %
T-8	29 %	47 %	19 %	5 %	0 %
T-7	26 %	50 %	20 %	5 %	0 %
T-6	22 %	52 %	21 %	5 %	0 %
T-5	18 %	54 %	22 %	5 %	0 %
T-4	15 %	57 %	23 %	5 %	0 %
T-3	11 %	59 %	25 %	5 %	0 %
T-2	7 %	62 %	26 %	5 %	0 %
T-1	4 %	64 %	27 %	5 %	0 %
T-0	0 %	50 %	0 %	0 %	0 %
T+1	0 %	0 %	0 %	0 %	50 %
T+2	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %
T+3	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %

Från indexets måldatum och enligt tabellen ovan kommer indexet gradvis att omfatta godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index.

[30] Denna beskrivning av delfonden kan justeras vid tidpunkten för måldatumet för att återspegla eventuella ändringar i placeringsinriktningen.

Delfonden kommer att avvecklas inom tre (3) år efter indexmåldatum efter föregående meddelanden till andelsägare. Andelsägarna i delfonden får därför sina andelar inlösta i enlighet med tidsplanen i ett sådant meddelande.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIILC33

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om ”hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Replikering av
Indexreplikering	samplingsindex
Investeringsfond	Användning av tekniker
Likviditet på	och instrument
noteringsmarknad	Hållbara investeringar
(ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Lifecycle 2036[31]

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2036 Screened Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet strävar efter att representera resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2036 (”**måldatumet för indexet**”).

Indexet består av godtagbara globala aktier från FTSE Developed Screened Select Index och räntebärande värdepapper denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, FTSE EMU Government Bond Select Index, FTSE EMU Government Green Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index.

I sin konstruktion beaktar indexet därtill faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Indexet är ett nettoavkastningsindex

–nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning
–kupongutbetalningarna från indexets beståndsdelar som är räntepapper ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet består av alla de värdepapper som omfattar fem följande underliggande index:

- FTSE Developed Screened Select Index är ett aktieindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör tre regioner, Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index är ett obligationsindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index – Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer som är representativt för statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE EMU Government Green Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som grön obligation av Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat, enligt beskrivningen i bilaga i, ESG-relaterade upplysningar

- FTSE EMU Government Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, är denominerade i euro samt emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

- FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och som är emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

Viktningen för varje underliggande index i indexet baseras på en förutbestämd glidande skala (enligt indexmetoden) som representerar förändringen av tillgångsklasser och underliggande index över tid fram till indexets måldatum.

Den glidande skalan är fördefinierat enligt indexmetoden och illustreras i tabellen nedan:

År till indexets måldatum November 2036 (T)	FTSE Developed Screened Select Index	FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index	FTSE EMU Government Bond Select Index	FTSE EMU Government Green Bond Select Index	FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index
T-12.25	45 %	37 %	13 %	5 %	0 %
T-12	44 %	37 %	14 %	5 %	0 %
T-11	40 %	40 %	15 %	5 %	0 %
T-10	37 %	42 %	16 %	5 %	0 %
T-9	33 %	45 %	17 %	5 %	0 %
T-8	29 %	47 %	19 %	5 %	0 %
T-7	26 %	50 %	20 %	5 %	0 %
T-6	22 %	52 %	21 %	5 %	0 %
T-5	18 %	54 %	22 %	5 %	0 %
T-4	15 %	57 %	23 %	5 %	0 %
T-3	11 %	59 %	25 %	5 %	0 %
T-2	7 %	62 %	26 %	5 %	0 %
T-1	4 %	64 %	27 %	5 %	0 %
T-0	0 %	50 %	0 %	0 %	50 %
T+1	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %
T+2	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %
T+3	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %

Från indexets måldatum och enligt tabellen ovan kommer indexet gradvis att omfatta godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index.

[31] Denna beskrivning av delfonden kan justeras vid tidpunkten för måldatumet för att återspegla eventuella ändringar i placeringsinriktningen.

Delfonden kommer att avvecklas inom tre (3) år efter indexmåldatum efter föregående meddelanden till andelsägare. Andelsägarna i delfonden får därför sina andelar inlösta i enlighet med tidsplanen i ett sådant meddelande.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIILC36

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om ”hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Lifecycle 2039[32]

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2039 Screened Select Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet

Indexet strävar efter att representera resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2039 (”**måldatumet för indexet**”).

Indexet består av godtagbara globala aktier från FTSE Developed Screened Select Index och räntebärande värdepapper denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, FTSE EMU Government Bond Select Index, FTSE EMU Government Green Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index.

I sin konstruktion beaktar indexet därtill faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Indexet är ett nettoavkastningsindex

–nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning
–kupongutbetalningarna från indexets beståndsdelar som är räntepapper ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta

Euro

Indexets sammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet består av alla de värdepapper som omfattar fem följande underliggande index:

- FTSE Developed Screened Select Index är ett aktieindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör tre regioner, Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index är ett obligationsindex baserat på det viktade börsvärdet för FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index – Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer som är representativt för statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

- FTSE EMU Government Green Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som grön obligation av Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat, enligt beskrivningen i bilaga i, ESG-relaterade upplysningar

- FTSE EMU Government Bond Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, är denominerade i euro samt emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

- FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index är ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta, och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och som är emitterade av länder inom EMU som uppfyller de specifika kriterierna för FTSE World Government Bond Index (WGBI), till exempel landsklassificering, tillgänglighetsnivå eller minsta marknadsvärde på 40 miljarder euro.

Viktningen för varje underliggande index i indexet baseras på en förutbestämd glidande skala (enligt indexmetoden) som representerar förändringen av tillgångsklasser och underliggande index över tid fram till indexets måldatum.

Den glidande skalan är fördefinierat enligt indexmetoden och illustreras i tabellen nedan:

År till indexets måldatum November 2039 (T)	FTSE Developed Screened Select Index	FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index	FTSE EMU Government Bond Select Index	FTSE EMU Government Green Bond Select Index	FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index
T-15.25	56 %	30 %	10 %	5 %	0 %
T-15	55 %	30 %	10 %	5 %	0 %
T-14	51 %	32 %	11 %	5 %	0 %
T-13	48 %	35 %	12 %	5 %	0 %
T-12	44 %	37 %	14 %	5 %	0 %
T-11	40 %	40 %	15 %	5 %	0 %
T-10	37 %	42 %	16 %	5 %	0 %
T-9	33 %	45 %	17 %	5 %	0 %
T-8	29 %	47 %	19 %	5 %	0 %
T-7	26 %	50 %	20 %	5 %	0 %
T-6	22 %	52 %	21 %	5 %	0 %
T-5	18 %	54 %	22 %	5 %	0 %
T-4	15 %	57 %	23 %	5 %	0 %
T-3	11 %	59 %	25 %	5 %	0 %
T-2	7 %	62 %	26 %	5 %	0 %
T-1	4 %	64 %	27 %	5 %	0 %
T-0	0 %	50 %	0 %	0 %	50 %
T+1	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %
T+2	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %
T+3	0 %	0 %	0 %	0 %	100 %

[32] Denna beskrivning av delfonden kan justeras vid tidpunkten för måldatumet för att återspegla eventuella ändringar i placeringsinriktningen.

Från indexets måldatum och enligt tabellen ovan kommer indexet gradvis att omfatta godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index.

Delfonden kommer att avvecklas inom tre (3) år efter indexmåldatum efter föregående meddelanden till andelsägare. Andelsägarna i delfonden får därför sina andelar inlösta i enlighet med tidsplanen i ett sådant meddelande.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIILC39

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om ”hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk motsvarande upp till 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkurssättning.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Replikering av samplingsindex
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Global Treasury Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Global Aggregate Treasuries Index(”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är en deluppsättning av sitt överordnade index, Bloomberg Global Aggregate Index, (”**moderindex**”), som endast filtrerar för värdepapper med endast statlig sektor.
Det överordnade indexet är ett jämförelseindex för flera valutor bestående av statsobligationer, statsrelaterade obligationer, företagsobligationer och värdepapperiserade obligationer med fast ränta och i lokal valuta från både utvecklade marknader och tillväxtmarknader.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet är ett jämförelseindex för flera valutor som inkluderar statsobligationer med fast ränta med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor. Värdepapperen som ingår i indexet har högt kreditbetyg (enligt medelbetyget från Moodys, S&P och Fitch) och har minst ett års återstående löptid.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: LGTRTRUU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Förvaltning
Tillväxtmarknader	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Hållbarhet
Ränta	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	
Kredit	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF – USD	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Global Corporate Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är en deluppsättning av sitt överordnade index, Bloomberg Global Aggregate Index, (”**moderindex**”), som endast filtrerar för värdepapper med endast företagssektor. Det överordnade indexet är ett jämförelseindex för flera valutor bestående av statsobligationer, statsrelaterade obligationer, företagsobligationer och värdepapperiserade obligationer med fast ränta och i lokal valuta från både utvecklade marknader och tillväxtmarknader.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet är ett jämförelseindex för flera valutor som inkluderar företagsobligationer med fast ränta med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor.
Värdepapperen som ingår i indexet har högt kreditbetyg (enligt medelbetyget från Moodys, S&P och Fitch) och har minst ett års återstående löptid.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: LGCPTRUU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat Tillväxtmarknader	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering Ränta	Hållbarhet
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,08 %	0,07 %
UCITS ETF USD HEDGED Acc	USD	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,07 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Euro Government Low Duration Tilted Green Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet kombinerar Bloomberg Euro Treasury 50bn 3-5 Bond Index med Bloomberg Euro Treasury Green Bond 1M+ Select Country Index, som mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta, som är denominerade i euro.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet kombinerar Bloomberg Euro Treasury 50bn 3-5 Bond Index med Bloomberg Euro Treasury Green Bond 1M+ Select Country Index, som mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta, som är denominerade i euro, emitterade av stater som är medlemmar i den europeiska ekonomiska och monetära unionen. Indexet justerar viktningen av enskilda gröna obligationer baserat på deras återstående löptid till förfallodag. Dessutom måste det totala marknadsvärdet på gröna obligationer utgöra 30 % av indexet. Landsviktningarna är i linje med Bloomberg Euro Treasury 50bn 3-5 Bond Index. Ytterligare ESG-kriterier beskrivs närmare i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I38964EU

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om ”hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

- Derivat
- Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
- Indexreplikering
- Räntesats
- Investeringsfond
- Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
- Kredit
- Förvaltning
- Marknad
- Replikering av samplingsindex
- Hållbara investeringar
- Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

- Motpart
- Operativ
- Standard
- Likviditet
- Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %
UCITS ETF Acc	EUR	1 000 000 USD	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi STOXX Europe Defense

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för STOXX Europe Total Market Defense Capped Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på STOXX Europe Total Market Index (”**moderindexet**”) och är utformat för att återspegla resultatet för företag som klassificerats i luftfarts- och försvarssektorn, enligt Industry Classification Benchmark (”**ICB**”), och som har bevisad intäktsexponering mot försvarsverksamhet.

Intäktsexponeringen mot försvar definieras med Revere-data (RBICS) och indexet strävar efter att återspegla företag med bevisad exponering mot försvarstemat.
Moderindexet omfattar ungefär 95 procent av det fritt omsättningsbara börsvärdet i 17 europeiska länder: Österrike, Belgien, Polen, Danmark, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Norge, Portugal, Spanien, Sverige, Schweiz och Storbritannien.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexets investeringsområde definieras av alla aktier som ingår i moderindexet. Sedan granskas alla värdepapper i investeringsområdet beträffande nedanstående information vid brytdatumet:

Steg 1. ICB-klassificeringsgranskning: Endast komponenter vars ICB-sektorklassificering hör till ICB-sektorn luftfart och försvar är godtagbara.
Steg 2. Urvalsgranskning:

- Godtagbara företag som ingår i ICB-undersektorn försvar tas med i indexet.
- De återstående godtagbara företagen utvärderas utifrån sin intäktsexponering mot de sammanlagda underteman för kärnintäkter och utökade intäkter enligt definitionen i indexmetoden. Endast företag med en intäktsexponering som är större än 0 väljs ut, där intäktsexponeringen mot utvidgade intäktssektorer endast inkluderar den del av intäkterna som är relevant för försvarsverksamhet och militär verksamhet.

Alla värdepapper i investeringsområdet som klarade ovannämnda urvalsgranskningar väljs ut för indexets slutliga sammansättning. Varje aktie viktas sedan utifrån sitt fritt omsättningsbara börsvärde med ett tak på 10 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

STOXX:s officiella index beräknas utifrån:
–de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
–WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SXDCR

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Koncentration	Investeringsfond
Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbarhet
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Indexreplikering	
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet "Termer med specifika betydelser" för definitionerna av termerna "bankdag" och "transaktionsdag".

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade "UCITS ETF": 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade "UCITS ETF": 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden ("**T-NAV**") beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.
STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.
Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.
STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.
Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi Singapore Straits Times

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Straits Times Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas på den singaporianska marknaden. Indexet består av de 30 största och mest likvida företagen som är noterade på den singaporianska börsen. Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
SGD

Indexets sammansättning
Aktierna viktas utifrån sitt fritt omsättningsbara börsvärde och granskas beträffande likviditet för att se till att indexet förblir både omsättningsbart och investeringsbart.

Indexrevision
Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: TSTIS

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 60 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: SGD

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

- Kredit
- Valuta
- Derivat
- Aktieexponering
- Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
- Indexreplikering
- Räntesats
- Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
- Investeringsfond
- Förvaltning
- Replikering av samplingsindex
- Hållbarhet
- Användning av tekniker och instrument
- Marknad

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden
- Motpart
- Operativ
- Standard
- Likviditet
- Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
AS Acc	SGD	–	4,50 %	1,00 %	0,08 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi MSCI Europe Screened

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Europe Screened ex-Thermal Coal Index(”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index (”**moderindexet**”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 15 länder med utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter också företaget från moderindexet baserat på ESG-kriterier (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Indexet har som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet. Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Beståndsdelarna i MSCI Europe Screened ex-Thermal Coal Index väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet, som beskrivs närmare i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUSCNE
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker samt beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om ”hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 51 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Aktieexponering	Hållbara investeringar
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Investeringsfond

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,07 %
UCITS ETF Dist	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Core GBP Corporate Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Sterling Corporate Bond Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet mäter resultatet för GBP-noterade företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg emitterade av företagsemittenter.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Brittiska pund

Indexets sammansättning
Indexet är en komponent i bredbaserade Bloomberg Barclays flaggskeppsindex – såsom Sterling Aggregate Index och Global Aggregate Index i flera valutor – för att mäta resultatet för företagsobligationer med höga kreditbetyg, betecknade i GBP, emitterade på både globala och regionala marknader. Indexet inkluderar offentligt emitterade värdepapper av industriella, allmännyttiga och finansiella emittenter med en löptid på minst ett år och en fast minsta emissionsstorlek.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.
Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: LC61TRGU
Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.15 (London-tid).
Vid indexberäkningen används köpkurser.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Brittiska pund

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Indexreplikering	Replikering av samplingsindex
Räntesats	Hållbarhet
Investeringsfond	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	GBP	100 000 GBP	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %
UCITS ETF Dist	GBP	100 000 GBP	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Fixed Maturity 2030 Euro Government Bond Broad[33]

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för FTSE Euro Broad Government 2030 Maturity Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdets medlemsländer med förfallodag 2030.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:
- Statsobligationer med fast ränta
- Godtagbara emitterande länder: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien.
- Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 1 januari 2030 och den 15 december 2030.

Listan över statsobligationer som ingår i indexet är statisk. Det utestående nominella beloppet för varje obligation fastställs vid start och förblir fast till förfallodagen.
Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde.
Indexets beståndsdelar förblir fasta fram till ett år före förfallodagen.

Under detta sista år förfaller de obligationer som ingår i indexet gradvis. Ränta och huvudsakliga utbetalningar från förfallna obligationer återinvesteras i statspapper som emitterats av Frankrike och Tyskland (statsskuldsväxlar).

Varje statsskuldväxel har en till sex månaders återstående löptid till förfallodag per varje månatlig ombalanseringsdag med ett tak på 28 %.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE (”**FTSE**”).

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIEB30

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.
Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Koncentration	Investeringsfond
Kredit	Förvaltning
Valuta	Replikering av samplingsindex
Derivat	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet
Indexreplikering	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

[33] *Under 12 månader före förfallodagen får delfonden inte längre betraktas som en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010.*

	Fast förfallodag[34]

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standard
Operativ	Standardmetoder
	Likviditet

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet
- har för avsikt att inneha investering tills alla obligationer som ingår i indexet har förfallit.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

[34] Observera att delfonden har en fast förfallodag den 31 december 2030. Enligt beslut från styrelsen kan andelsägare i delfonden lösa in sina andelar på förfallodagen, utan ytterligare meddelande eller andelsägares godkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.
Obligationer som delfonden investerar i för att följa indexets avkastning har förfallodag under hela det sista året av löptiden. Det är viktigt att investerare beaktar detta före investering i delfonden under det sista året och under den period som föregår det sista året.
Till exempel bör investerare som söker exponering mot statsobligationer i euro vara medvetna om att delfonden kanske inte är lämplig för nya investeringar under det sista året eller under den period som föregår det sista året.
Delfonden försöker inte ge utdelning i form av ett förutbestämt belopp vid förfallodagen eller vid periodiska utdelningar.

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,04 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEX OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi MSCI Global Small Cap OECD Ex USA

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI World ex USA OECD Custom Countries Small Cap Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex representativt för små företag i OECD-länder, exklusive USA. Indexet syftar till att motsvara resultatet för värdepapper med lågt börsvärde baserat på deras justerade fritt omsättningsbara börsvärden.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexets beståndsdelar väljs baserat på deras justerade fritt omsättningsbara börsvärden som gäller för utländska investerare. Vikten för varje land varierar beroende på marknadens rörelser.
Indexet omfattar inte värdepapper från USA, eller värdepapper börsnoterade, klassificerade eller registrerade i länder utanför OECD.
Medlemsstatus i OECD för respektive land granskas liksom tidigare vid månadsslut vid indexets granskning.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
- de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NE739343
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 51 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Indexreplikering
Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Investering	Säkring
Aktier i små och medelstora företag	Likviditet på noteringsmarknad
Hållbarhet	Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITSUCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
IE Acc	EUR	USD 500 000	3,50 %	1,00 %	0,25 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Global ex-US Government Bond

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg Global Treasury Large Markets DM ex US Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är en deluppsättning av moderindexet, Bloomberg Global Treasury Large Markets Index (”**moderindexet**”), som filtrerar värdepapper som emitterats av USA eller ett land på Bloomberg-indexens lista över tillväxtmarknadsländer.
Indexet är ett jämförelseindex med flera valutor, som mäter resultatet för lokala statliga skuldförbindelser med fast ränta från länder med höga kreditbetyg.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet är ett jämförelseindex med flera valutor som inbegriper lokala statliga skuldförbindelser med fast ränta och en fastställd minsta emissionsstorlek.

- Landsstorlek: landsstorlekar granskas årligen i juli och måste ha haft minst 40 miljarder US-dollar i utestående belopp i lokal valuta som är godtagbart för statsobligationsindex per de föregående 6 månadssluten.
- Länders kreditbetyg: länder måste ha ett Bloomberg Index-kreditbetyg på A-/A3/A- eller högre för att få ingå i indexet under varje årlig granskning i juli. När det ingår i indexet, och om Bloomberg Index-kreditbetyget sjunker under BBB-/BAA3/BBB-, utesluts landet från indexet vid ombalanseringen vid nästa månadsslut.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I40296US

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra godtagbara tillgångar som är representativa för de värdepapper som ingår i indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk motsvarande upp till 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkurssättning.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.
Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Investeringsfond
Derivat	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
Indexreplikering	Förvaltning
Räntesats	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Hållbarhet
Kredit	Replikering av samplingsindex

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standardmetoder
Operativ	Standard
Likviditet	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %
UCITS ETF USD Hedged Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

Amundi Global Government Bond GDP-Weighted[1]

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för FTSE GDP-Adjusted World Government Bond Index ("**indexet**") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är en BNP-justerad version av FTSE World Government Bond Index (det "**överordnade indexet**"), ett obligationsindex i flera valutor som är representativt för statsobligationer med fast ränta från länder med höga kreditbetyg och en fast minsta emissionsstorlek.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet är ett jämförelseindex med flera valutor som inbegriper lokala statliga skuldförbindelser med fast ränta och en fastställd minsta emissionsstorlek.
Indexets investeringsområde omfattar alla värdepapper som ingår i dess överordnade index.
Länderna viktas efter nominell bruttonationalprodukt (BNP). Inom varje land allokeras landets vikt proportionellt mellan värdepapperen utifrån deras börsvärde i det underliggande indexet.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av FTSE ("**FTSE**").

FTSE:s officiella index beräknas av FTSE utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIWDPU

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på www.ftse.com

[1]Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt betydelsen av artikel 44 i lagen av den 17 december 2010

Förvaltningsprocess

Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten "Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering" och "Replikeringsmetoder" i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
Kredit	Förvaltning
Derivat	Marknad
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Replikering av samplingsindex
Indexreplikering	Investeringsfond
Räntesats	Användning av tekniker och instrument
Hållbarhet	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Operativ
Likviditet	Standardmetoder
Standard	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 4 år.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,10 %	0,10 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %
UCITS ETF USD Hedged Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,12 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED (”FTSE”) ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC (”EXCHANGE”) ELLER AV FINANCIAL TIMES LIMITED (”FT”) (TILLSAMMANS ”LICENSGIVARPARTERNA”) OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA LÄMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÄSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA INDEXET OCH/ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX ÄR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT NÅGON PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I INDEXET OCH INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA ÄR SKYLDIG ATT MEDDELA NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ”FTSE®”, ”FT-SE®”, ”FOOTSIE® ”, ”FTSE4GOOD®” OCH ”TECHMARK®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE EXCHANGE OCH FT OCH ANVÄNDS AV FTSE UNDER LICENS. ”ALL-WORLD®”, ”ALL-SHARE®” OCH ”ALL-SMALL®” ÄR VARUMÄRKEN TILLHÖRANDE FTSE.

Amundi Euro Stoxx 50 Target Income

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för EURO STOXX 50 Covered Call Target Income Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet mäter resultatet av en systematisk, partiell strategi för täckta köpoptioner med lösenpris vid nuvarande kurs. Strategin består av att ha en lång exponering mot EURO STOXX 50 Net Total Return Index och en kort exponering mot en följd av månatliga köpoptioner på EURO STOXX 50 Option (det ”**underliggande indexet**”).

Denna metod syftar till att generera årliga intäkter enligt målet på 8 % genom optionspremier och den positiva skillnaden mellan långa och korta exponeringar mot underliggande index. Samtidigt begränsas deltagande i positiv utveckling om indexnivån stiger över lösenpriset. Om indexnivån sjunker bör premien delvis bidra till att kompensera för förlusten.
För att uppnå årliga intäkter enligt målet på 8 % justeras antalet sålda optioner varje månad (”**täckningsgraden**”) beroende på värdet på optionerna. Som ett resultat kan köpoptioner utfärdas på endast en del av den totala nominella exponeringen. Detta innebär att vinster på den täckta delen av de utfärdade köpoptionerna är begränsade till det tillämpliga lösenpriset, medan den återstående otäckta exponeringen fortsätter att ge ett deltagande fullt ut i vinster över lösenpriset.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
En köpoption är ett tvåpartsavtal där köparen förvärvar rätten, men inte skyldigheten, att köpa tillgångar av säljaren till ett förutbestämt pris och vid ett visst framtida datum, mot en förskottsbetalning till säljaren som kallas premie. Genom detta avtal kan säljaren få omedelbara intäkter genom att ta emot premien, samtidigt som man strävar efter att begränsa eventuella förluster som kan uppstå om köparen utnyttjar köpoptionerna.

Varje månad justerar indexet täckningsgraden i enlighet med strategins syfte och upprätthåller täckningen genom att ha lång exponering mot det underliggande indexet.

Optionspositionen består av en försäljning av en börsnoterad köpoption med följande egenskaper:
1. Ha ett lösenpris som motsvarar eller ligger något över marknadspriset för det ”underliggande indexet”
2. Vara rullande på månadsbasis
3. Handlas på Eurex Stock Exchange.

Det underliggande indexet omfattar aktier som täcker alla ekonomiska sektorer och som väljs för sin börsvärdesnivå, sin likviditet och viktningen i sin sektor.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SXCCTI8
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.
Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Koncentration	Indirekt replikering
Täckt köpoption	Investeringsfond

Derivat	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Implicit volatilitet	Hållbarhet
Indexreplikering	Volatilitet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.

STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.

Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.

STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.

Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi Nasdaq-100 Target Income

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Nasdaq - 100 8% Income Target Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet mäter resultatet av en systematisk, partiell strategi för täckta köpoptioner med lösenpris vid nuvarande kurs. Strategin består av att ha en lång exponering mot Nasdaq-100 Notional Net Total Return Index (XNDXNNR) och en kort exponering mot en följd av månatliga köpoptioner på Nasdaq-100 (NDX) (det ”**underliggande indexet**”).

Denna metod syftar till att generera årliga intäkter enligt målet på 8 % genom optionspremier och den positiva skillnaden mellan långa och korta exponeringar mot underliggande index. Samtidigt begränsas deltagande i positiv utveckling om indexnivån stiger över lösenpriset. Om indexnivån sjunker bör premien delvis bidra till att kompensera för förlusten.
För att uppnå årliga intäkter enligt målet på 8 % justeras antalet sålda optioner varje månad (”**täckningsgraden**”) beroende på värdet på optionerna. Som ett resultat kan köpoptioner utfärdas på endast en del av den totala nominella exponeringen. Detta innebär att vinster på den täckta delen av de utfärdade köpoptionerna är begränsade till det tillämpliga lösenpriset, medan den återstående otäckta exponeringen fortsätter att ge ett deltagande fullt ut i vinster över lösenpriset.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
En köpoption är ett tvåpartsavtal där köparen förvärvar rätten, men inte skyldigheten, att köpa tillgångar av säljaren till ett förutbestämt pris och vid ett visst framtida datum, mot en förskottsbetalning till säljaren som kallas premie. Genom detta avtal kan säljaren få omedelbara intäkter genom att ta emot premien, samtidigt som man strävar efter att begränsa eventuella förluster som kan uppstå om köparen utnyttjar köpoptionerna.

Varje månad justerar indexet täckningsgraden i enlighet med strategins syfte och upprätthåller täckningen genom att ha lång exponering mot det underliggande indexet.

Optionspositionen består av en försäljning av en börsnoterad köpoption med följande egenskaper:
1. Ha ett lösenpris som motsvarar eller ligger något över marknadspriset för det ”underliggande indexet”
2. Vara rullande på månadsbasis
3. Handlas på Nasdaq Stock Exchange.

Det underliggande indexet speglar de 100 största företagen efter börsvärde inom stora branschgrupper, inklusive hårdvara och programvara, telekommunikation, detaljhandel/grossisthandel och bioteknik.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Nasdaq.

Indexet beräknas av NASDAQ OMX med hjälp av de officiella stängningskurserna på den NASDAQ-börs där de värdepapper som ingår i indexet handlas.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: NDXTII8
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Nasdaq-indexet finns på www.indexes.nasdaqomx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.
Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Koncentration	Indirekt replikering
Täckt köpoption	Investeringsfond
Derivat	Likviditet på
Säkringsrisk (säkrad	noteringsmarknad
andelsklass)	(ETF-andelsklass)
Aktieexponering	Förvaltning
Implicit volatilitet	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
	Volatilitet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,30 %	0,10 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

Produkterna sponsras, rekommenderas, säljs eller marknadsförs inte av NASDAQ OMX Group, Inc. eller dess närstående företag (NASDAQ OMX med dess närstående företag, kallas ”bolagen”). Bolagen har inte kontrollerat lagligheten eller lämpligheten i, eller riktigheten eller korrektheten i beskrivningar och upplysningar som rör produkten/produkterna. Bolagen gör inga utfästelser eller garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av produkterna eller någon medlem av allmänheten om lämpligheten i att investera i värdepapper i allmänhet eller i produkterna i synnerhet, eller förmågan hos Nasdaq-100 Index® att följa allmänna börsresultat. Bolagens enda förhållande till Amundi Investment Solutions (”Amundi Asset Management”) är licensiering av de registrerade varumärkena NASDAQ®, OMX®, NASDAQ OMX®, Nasdaq-100® och Nasdaq-100 Index®, och vissa varunamn för bolagen och användningen av Nasdaq-100 Index® som fastställs, sätts samman och beräknas av NASDAQ OMX utan hänsyn till Amundi Asset Management eller produkterna. NASDAQ OMX har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller till ägarna av produkterna när Nasdaq-100 Index® fastställs, sätts samman och beräknas. Bolagen är inte ansvariga för och har inte deltagit i fastställandet av tidpunkten för, priserna vid eller kvantiteter av den eller de produkter som ska utfärdas eller vid fastställandet eller beräkningen av den ekvation genom vilken produkterna ska omvandlas till kontanter. Bolagen har inget ansvar i samband med administration, marknadsföring eller handel med produkterna.

BOLAGEN GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER OAVBRUTEN BERÄKNING AV NASDAQ-100 INDEX® ELLER NÅGON DATA SOM INGÅR DÄRI. BOLAGEN GER INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM AMUNDI ASSET MANAGEMENT, PRODUKTERNAS ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG TILL FÖLJD AV ANVÄNDNING AV NASDAQ-100 INDEX® ELLER DATA DÄRI. BOLAGEN GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE BETRÄFFANDE NASDAQ-100 INDEX® ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE SKA BOLAGEN UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR FÖRLORADE VINSTER ELLER SÄRSKILDA, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR, ÄVEN OM DET MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN TILL SÅDANA SKADOR.

Amundi Euro Stoxx

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för EURO STOXX Net Return Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som utgör en del av STOXX 600 Index. Indexet är representativt för stora, medelstora och små företag i länder i euroområdet, som till exempel men inte begränsat till: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Luxemburg, Nederländerna, Portugal och Spanien.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
Euro

Indexets sammansättning
Indexet omfattar aktier i företag med säte i euroområdet som täcker alla ekonomiska sektorer och som väljs ut utifrån börsvärde, likviditet och sektorsvikt.
Varje komponent viktas utifrån fritt omsättningsbart börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Stoxx.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.
På prospektets datum används följande kortnamn: SXXT
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på www.stoxx.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

Delfonden avser att implementera en replikeringsmodell med urval för att följa indexets utveckling, och det förväntas därför inte att delfonden alltid innehar alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehar dem i samma proportion som deras viktningar i indexet.
Delfonden kan även inneha vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Plan d’Epargne en Actions (PEA) : Berättigad

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)

Minst 51 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Förvaltning
Aktieexponering	Marknad
Indexreplikering	Volatilitet
Investeringsfond	Hållbarhet
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Valuta

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Operativ
Likviditet	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %
UCITS ETF DIST	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

STOXX och dess licensgivare (”**licensgivarna**”) har ingen annan relation till Amundi Asset Management än licensiering av indexet och relaterade varumärken för användning i samband med delfonden.

STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte delfonden.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i delfonden eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av delfonden.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av delfonden.
- Beaktar inte behovet hos delfonden eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till delfonden.

Mer specifikt, STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och frånsäger sig alla garantier beträffande följande:

- De resultat som kan erhållas av delfonden, ägare av delfonden eller andra personer i samband med användningen av indexet och data i indexet.
- Att indexet och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av indexet och dess data.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i indexet eller dess data.

STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadeståndsberättigande, särskilda eller efterföljande skador eller förluster, även om STOXX eller dess licensgivare vet att sådana kan uppstå.

Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och STOXX är endast till för dem och inte för ägarna av delfonden eller andra tredje parter.

Amundi Core MSCI USA Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI USA Net TR USD Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora aktiesegment på aktiemarknaden i USA.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexkomponenterna väljs ut och viktas utifrån fritt omsättningsbart börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDDUUS
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.
I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.
Den tyska investeringsskattelagen
Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
1 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswap. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Derivat	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
Aktieexponering	Förvaltning
Indexreplikering	Marknad
Investeringsfond	Hållbarhet
Indirekt replikering	Aktier i små och medelstora företag
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	Volatilitet

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,03 %	0,02 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,03 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,04 %	0,03 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi Core MSCI ACWI Swap

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI ACWI Net TR USD Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett marknadsviktat index justerat efter fritt omsättningsbart börsvärde som mäter investeringsområdet och resultatet för börsnoterade företag på utvecklade marknader och tillväxtmarknader.
Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet består av företag med medelstort och stort börsvärde och är sammansatt enligt metodiken för MSCI Global Investable Market Index (GIMI) för att uppfylla vissa specifika krav på storlek, likviditet och justerat fritt omsättningsbart börsvärde.
Indexet omfattar ungefär 85 % av de globala investeringsbara aktiemöjligheterna.
MSCI:s metodik och beräkningsmetod utgår från att antalet företag i indexet varierar.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI (”**MSCI**”).

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:

– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas

– WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M1WD
Det resultat som följs är stängningskursen för Index.
Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet kommer att uppnås genom en indirekt replikering genom att investera i finansiella derivatinstrument som ger indexets resultat i utbyte mot resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 92 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden byter resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden mot indexets resultat genom ett derivatkontrakt eller en totalavkastningsswapp. Mer information finns i avsnitten ”Tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder för index och UCITS ETF-delfonder” i detta prospekt.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Hållbarhet
Derivat	Tillväxtmarknader
Aktieexponering	Aktier i små och medelstora företag
Indexreplikering	Volatilitet
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
Förvaltning	Indirekt replikering
Marknad	Förvaltning av säkerheter
Förvaringsrisk	Investeringsfond

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering
Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

– är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt

– strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Substansvärdets publiceringsdag Byta in/ut	**Transaktionsdag +1** Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,07 %
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,07 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.

TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

Amundi US TIPS Ultrashort*

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för Bloomberg US TIPS Ultrashort Laddered Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet mäter utvecklingen för de åtta värdepapper som inflationsskyddas av USA:s finansdepartement (TIPS) som har kortast återstående löptid.
Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
För att kunna ingå i indexet måste en obligation vara en TIPS-obligation denominerade i US-dollar, utfärdad av det amerikanska finansdepartementet, med fast ränta. Obligationen ska ursprungligen ha utfärdats med en löptid på antingen fem eller tio år och ha höga kreditbetyg. Om det endast finns betyg från två kreditvärderingsinstitut ska det lägre av de två betygen gälla.

Vid varje ombalanseringsdatum:
– Först rangordnas alla kvalificerade obligationer i stigande ordning baserat på återstående löptid. De åtta värdepapper med kortast återstående löptid väljs ut för att ingå i indexet.
– Därefter tilldelas obligationen med kortast återstående löptid en vikt på 8 procent av indexet, mätt utifrån marknadsvärdet. De återstående sju obligationerna tilldelas alla lika stor vikt.
Det finns ingen minimigräns för återstående tid till slutlig förfallodag. Kontanter som erhålls under månaden från amorteringar och kupongutbetalningar behålls i indexet fram till ombalanseringsdatumet vid månadsskiftet, då de återinvesteras enligt indexets viktningsmetodik.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg.

På prospektets datum används följande kortnamn: I40823US

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.00 (New York-tid).

Vid indexberäkningen används mittkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på www.bloomberg.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

I investeringsprocessen beaktar delfonden investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbara investeringar” i detta prospekt, och den kommer inte att inneha några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i ”Replikeringsmetoder”.

Aktiv risk
1 %.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.
De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

- Valuta
- Koncentration
- Derivat
- Räntesats
- Indexreplikering
- Säkringsrisk (säkrad andelsklass)
- Investeringsfond
- Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
- Förvaltning
- Marknad
- Volatilitet
- Hållbarhet
- Användning av tekniker och instrument

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

- Motpart
- Operativ
- Likviditet
- Standardmetoder
- Standard

Riskhanteringsmetod: Engagemang

* Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt meningen i artikel 44 i lagen av den 17 december 2010

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 1 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %
UCITS ETF EUR Hedged Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,05 %
UCITS ETF GBP Hedged Dist	GBP	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,05 %
UCITS ETF MXN Hedged Acc	MXN	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,07 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

”Bloomberg®” och Bloomberg Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited (”**BISL**”), administratören av indexet (gemensamt kallade ”**Bloomberg**”), och har licensierats för användning i vissa syften av Amundi Asset Management.

Delfonderna sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av Bloomberg. Bloomberg lämnar inga utfästelser eller garantier, uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av eller motparterna till delfonden eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i delfonden i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och indexet, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller delfonden. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av delfonden när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i delfonden. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning gentemot investerare i delfonden, avseende administration, marknadsföring eller handel med delfonden

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR INDEXET ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV DELFONDEN, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR INDEXET ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSGIVARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED DELFONDEN ELLER INDEXET ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

* Denna delfond är inte en delfond som följer index enligt meningen i artikel 44 i lagen av den 17 december 2010

Amundi MSCI Emerging Ex-China

Mål och placeringsinriktning

Mål
Att följa resultatet för MSCI Emerging Markets ex China Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexbeskrivning

Allmän beskrivning av indexet
Indexet är ett justerat fritt omsättningsbart börsvärde för aktier som syftar till att mäta utvecklingen för stora och medelstora företag i tillväxtmarknadsländer, exklusive Kina.

Indexet är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

Indexvaluta
US-dollar

Indexets sammansättning
Indexet bygger på metodiken för MSCI Global Investable Market Indices och tar hänsyn till investeringsuniversets storlek, likviditet samt minimikrav på fri omsättningsbar andel (free float).
Indexet består uteslutande av aktier från tillväxtmarknader och omfattar stora och medelstora företag i tillväxtmarknadsländer i hela världen, med undantag för Kina.
Indexets mål är att representera 85 procent av det fria omsättningsbara börsvärdet i varje tillväxtmarknadsland.

Varje komponent viktas utifrån fritt omsättningsbart börsvärde.

Indexrevision
Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

Index-publicering
Indexet beräknas och publiceras av MSCI.

MSCI:s officiella index beräknas av MSCI utifrån:
– de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas
– WM Reuters valutakurser vid stängning (16:00 GMT).

Indexets värde är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M1CXBRV

Det resultat som följs är stängningskursen för Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i indexet finns på msci.com

Förvaltningsprocess
Exponeringen mot indexet uppnås genom direkt replikering, huvudsakligen genom direkta investeringar i överlåtbara värdepapper och/eller andra tillåtna tillgångar som är representativa för de aktier som ingår i indexet i en proportion som ligger extremt nära deras proportion av indexet.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller i investeringsprocessen investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod.

Den tyska investeringsskattelagen (InvStG)
Minst 51 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börs eller handlas på en organiserad marknad. För tydlighetens skull omfattas investeringar i fastighetsfonder (REIT-fonder) (enligt definitionen från Tysklands finansdepartement), fondföretag och företag för kollektiva investeringar inte i denna procentsats.

Aktiv risk
2 %

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillträde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden inneha depositioner samtidigt som den behåller en full exponering mot indexet.

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som utlåning och lån av värdepapper, omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Sådana tekniker och instrument kan i synnerhet användas för att generera ytterligare intäkter.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Japan Ltd

Huvudsakliga risker
Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden
Delfonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

Valuta	Investeringsfond
Koncentration	Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
Derivat	Förvaltning
Räntesats	Marknad
Indexreplikering	Hållbarhet
Säkringsrisk (säkrad andelsklass)	

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Likviditet
Operativ	Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser att behålla sin investering i minst 5 år.
Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt
- strävar efter att replikera indexets resultat samtidigt som de accepterar medföljande risk och volatilitet

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”: 14:00 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 18:30 CET på bankdagen före relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %
UCITS ETF Dist	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,11 %	0,07 %
UCITS ETF Hedged EUR Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,07 %
UCITS ETF Hedged USD Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,07 %
UCITS ETF Hedged GBP Dist	GBP	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,13 %	0,07 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. (”MSCI”) ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLEVERANTÖRER ELLER TREDJE PARTER SOM DELTAR VID ELLER HAR KOPPLING TILL SAMMANSTÄLLNING ELLER UTFORMNING AV MSCI-INDEX (TILLSAMMANS KALLADE ”MSCI-PARTER”). MSCI-INDEX UTGÖR MSCI:S EXKLUSIVA EGENDOM OCH ÄR TJÄNSTEMÄRKEN SOM TILLHÖR MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÅGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÅ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN OCH BERÄKNAS AV MSCI UTAN HÄNSYN TILL AMUNDI ELLER DENNA DELFOND, DENNA DELFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.
INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DELFONDENS ANDELSÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER VID FASTSTÄLLANDE, SAMMANSÄTTNING ELLER BERÄKNING AV MSCI-INDEXEN. INGEN AV MSCI-PARTERNA ANSVARAR FÖR ELLER HAR DELTAGIT VID FASTSTÄLLANDET AV TIDPUNKTER, PRISER ELLER KVANTITETER FÖR EMISSION I DENNA DELFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DELFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DELFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DELFOND.
TROTS ATT MSCI INHÄMTAR INFORMATION SOM SKA INGÅ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÅN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÅLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÅGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÅGOT MSCI-INDEX ELLER NÅGRA DATA SOM INGÅR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÅGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÅR I DEM. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

DELFONDERNA FÖRVALTAS AKTIVT

Amundi EUR Cash Active

Typ av penningmarknadsdelfond

Delfonden är en aktivt förvaltad börshandlad fondföretagsfond som kvalificerar sig om en standardiserad penningmarknadsdelfond med rörligt nettotillgångsvärde enligt förordningen om penningmarknadsfonder.

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att ge en avkastning som är i linje med penningmarknadsräntan genom en aktivt förvaltad investeringsstrategi som strävar efter att bevara kapitalbeloppet och säkerställa likviditet genom att ha en portfölj med penningmarknadsinstrument med hög kreditkvalitet och samtidigt införliva ESG-kriterier i valet och analysen av delfondens investeringar.

Investering

För att uppnå sitt mål investerar delfonden minst 67 % av nettotillgångarna i ett brett urval av tillgångar som följer förordningen om penningmarknadsfonder och kan i synnerhet investera i obligationer, penningmarknadsinstrument med hög kreditkvalitet, insättningar hos kreditinstitut från offentliga och privata emittenter, penningmarknadslån med tillgångar som säkerhet (ABCP-papper), denominerade i euro eller säkrade mot euro.

Delfonden investerar högst 30 % av tillgångarna i penningmarknadsinstrument som emitterats eller garanterats av en stat, en lokal myndighet inom EU eller ett internationellt organ där minst ett EU-land är medlem.

Den vägda genomsnittliga löptiden i delfondens portfölj är 180 dagar och den vägda genomsnittliga livslängden är 365 dagar.

Delfonden kan även investera upp till 10 % av nettotillgångarna i andelar i andra penningmarknadsfonder.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Beskrivning av användning av jämförelseindex

Delfonden kan i *efterhand* använda den korta euroräntan (”€STR”) som en indikator för att bedöma delfondens resultat.

Delfonden förvaltas aktivt och har inga begränsningar relaterat till jämförelseindexet som inskränker portföljsammansättningen.

Förvaltningsprocess

Investeringsförvaltaren förvaltar delfonden aktivt och använder en strategi som införlivar både teknisk och fundamental analys, inklusive kreditanalys.

Denna förvaltningsprocess vägleder urvalet av kvalitetsemittenter och kortfristiga värdepapper med målet att sätta samman en portfölj av hög kvalitet med ett starkt fokus på likviditet och riskhantering.

Investeringsförvaltaren utför försiktiga och strikta förfaranden för likviditetshantering avseende delfonden för att säkerställa efterlevnad av den tillämpliga likviditetströskeln enligt definitionen i avsnittet ”Likviditetshantering och kundkännedom”.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte investeringars huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer i sin investeringsprocess eftersom målet är att ge en avkastning som är linje med penningmarknadsräntan genom en aktivt förvaltad investeringsstrategi.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Derivat kan endast användas för att säkra de inneboende ränte- eller växelkursriskerna i delfondens andra investeringar.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: Euro

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

- Kredit
- Valuta
- Derivat
- Hållbara investeringar
- Säkringsrisk
- Räntesats
- Investeringsfond
- Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)
- Förvaltning
- Marknad
- Användning av tekniker och instrument
- Penningmarknadsfond
- Låg ränta
- Hållbara investeringar

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

- Motpart
- Operativ
- Standard
- Likviditet
- Standardmetoder

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Kreditbetyg: Fonden har inte begärt ett externt kreditbetyg för delfonden.

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med delfonden och som avser att behålla sin investering från en dag till tre månader.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- Ha grundläggande kunskaper om investering i fonder och ingen eller begränsad erfarenhet av att investera i delfonden eller liknande fonder.
- Strävar efter att bevara en del av eller hela det kapital som investerats under den rekommenderade innehavstiden.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 15:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	EUR	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.

* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

Amundi USD Cash Active

Typ av penningmarknadsdelfond

Delfonden är en aktivt förvaltad börshandlad fondföretagsfond som kvalificerar sig om en standardiserad penningmarknadsdelfond med rörligt nettotillgångsvärde enligt förordningen om penningmarknadsfonder.

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att ge en avkastning som är i linje med penningmarknadsräntan genom en aktivt förvaltad investeringsstrategi som strävar efter att bevara kapitalbeloppet och säkerställa likviditet genom att ha en portfölj med penningmarknadsinstrument med hög kreditkvalitet och samtidigt införliva ESG-kriterier i valet och analysen av delfondens investeringar.

Investering

För att uppnå sitt mål investerar delfonden minst 67 % av nettotillgångarna i ett brett urval av tillgångar som följer förordningen om penningmarknadsfonder och kan i synnerhet investera i obligationer, penningmarknadsinstrument med hög kreditkvalitet, insättningar hos kreditinstitut från offentliga och privata emittenter, penningmarknadslån med tillgångar som säkerhet (ABCP-papper), denominerade i USD eller säkrade mot USD.

Delfonden investerar högst 30 % av tillgångarna i penningmarknadsinstrument som emitterats eller garanterats av en stat, en lokal myndighet inom EU eller ett internationellt organ där minst ett EU-land är medlem.

Den vägda genomsnittliga löptiden i delfondens portfölj är 180 dagar och den vägda genomsnittliga livslängden är 365 dagar.

Delfonden kan även investera upp till 10 % av nettotillgångarna i andelar i andra penningmarknadsfonder.

Delfonden är en finansiell produkt som bland annat främjar ESG-egenskaper i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Beskrivning av användning av jämförelseindex

Delfonden kan i *efterhand* använda US Federal Funds Capitalised som en indikator för att bedöma delfondens resultat.
Delfonden förvaltas aktivt och har inga begränsningar relaterat till jämförelseindexet som inskränker portföljsammansättningen.

Förvaltningsprocess

Investeringsförvaltaren förvaltar delfonden aktivt och använder en strategi som införlivar både teknisk och fundamental analys, inklusive kreditanalys.

Denna förvaltningsprocess vägleder urvalet av kvalitetsemittenter och kortfristiga värdepapper med målet att sätta samman en portfölj av hög kvalitet med ett starkt fokus på likviditet och riskhantering.

Investeringsförvaltaren utför försiktiga och strikta förfaranden för likviditetshantering avseende delfonden för att säkerställa efterlevnad av den tillämpliga likviditetströskeln enligt definitionen i avsnittet ”Likviditetshantering och kundkännedom”.

Delfonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte investeringars huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer i sin investeringsprocess eftersom målet är att ge en avkastning som är linje med penningmarknadsräntan genom en aktivt förvaltad investeringsstrategi.

Tekniker och instrument för värdepapper och derivat
Delfonden kan använda tekniker och instrument för en effektiv portföljförvaltning relaterade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, som omvända köpeavtal och återköpsavtal i syfte att förvalta fonden effektivt enligt beskrivningen i och i enlighet med avsnitten ”Tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering” och ”Replikeringsmetoder” i detta prospekt. Derivat kan endast användas för att säkra de inneboende ränte- eller växelkursriskerna i delfondens andra investeringar.

De högsta och förväntade andelarna av delfondens tillgångar som kan omfattas av transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen ”ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR”.

Delfondens basvaluta: US-dollar

Investeringsförvaltare
Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se ”Riskbeskrivningar” för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

Valuta	Förvaltning
Derivat	Marknad
Investeringsfond	Hållbara investeringar
Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)	Användning av tekniker och instrument
Räntesats	Säkringsrisk
Kredit	Penningmarknad
	Låg ränta

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

Motpart	Standardmetoder
Operativ	Standard
Likviditet	

Riskhanteringsmetod: Engagemang

Kreditbetyg Fonden har inte begärt ett externt kreditbetyg för delfonden.

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med delfonden och som avser att behålla sin investering från en dag till tre månader.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- Ha grundläggande kunskaper om investering i fonder och ingen eller begränsad erfarenhet av att investera i delfonden eller liknande fonder.
- Strävar efter att bevara en del av eller hela det kapital som investerats under den rekommenderade innehavstiden.

Se avsnittet ”Termer med specifika betydelser” för definitionerna av termerna ”bankdag” och ”transaktionsdag”.

Tidsfrist för transaktioner för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”: 15:00 CET på relevant transaktionsdag.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Publiceringsdag för substansvärde	**Transaktionsdag +1**
Byta in/ut	Tillåtet

Huvudsakliga andelsklasser och avgifter

			Avgifter för andelstransaktioner		Årsavgifter	
Andelsklass	**Valuta**	**Minsta initiala investering***	**Förvärv (max)**	**Byte (max)**	**Förvaltning (max)**	**Administration (max)**
UCITS ETF Acc	USD	USD 100 000	3,00 %	1,00 %	0,05 %	0,05 %

Se avsnittet ”Noteringar om delfondskostnader” i prospektet. Andra andelsklasser kan finnas tillgängliga. En aktuell lista över tillgängliga klasser finns på amundi.lu/amundi-index-solutions.
* Dessa minimivärden tillämpas i USD eller motsvarande belopp i den relevanta valutan för andelsklassen.

HÅLLBAR INVESTERING

Disclosureförordningen

Den 18 december 2019 tillkännagav Europeiska rådet och Europaparlamentet att de hade nått en politisk överenskommelse om förordningen om hållbarhetsupplysningar och upprättar därigenom en ram för hela Europa för att underlätta hållbara investeringar.

Disclosureförordningen ger ett harmoniserat tillvägagångssätt när det gäller upplysningar som rör hållbarhet för investerare inom Europeiska ekonomiska samarbetsområdets finansiella tjänstesektor.

Tillämpningsområdet för disclosureförordningen är mycket brett och omfattar ett mycket stort antal finansiella produkter (t.ex. UCITS-fonder, alternativa investeringsfonder, pensionsfonder osv.) och aktörer på finansmarknaden (t.ex. fondförvaltare och rådgivare auktoriserade av EU). Den strävar efter att uppnå större öppenhet när det gäller hur finansmarknadsaktörerna integrerar hållbarhetsrisker i sina investeringsbeslut och beakta negativa konsekvenser för hållbar utveckling i investeringsprocessen.

Dess mål är att (i) stärka skyddet för investerare i finansiella produkter, (ii) förbättra de upplysningar som lämnas till investerare av finansmarknadsaktörerna och (iii) förbättra de upplysningar som lämnas till investerare om de finansiella produkterna, bland annat för att göra det möjligt för investerare att fatta välgrundade investeringsbeslut.

Enligt förordningen om hållbarhetsupplysningar uppfyller förvaltningsbolaget kriterierna för en ”finansmarknadsaktör”, medan SICAV-fonden och varje delfond anses vara en ”finansiell produkt”.

Taxonomiförordningen

Taxonomiförordningen strävar efter att identifiera ekonomiska aktiviteter som kvalificerade som miljömässigt hållbara (”**hållbara aktiviteter**”).

Artikel 9 i taxonomiförordningen identifierar sådana verksamheter i enlighet med deras bidrag till sex miljömål: i) Begränsning av klimatförändringar, (ii) anpassning till klimatförändringar, (iii) hållbar användning och skydd av vatten och marina resurser, (iv) övergång till en cirkulär ekonomi, (v) förhindrande och kontroll av föroreningar, (vi) skydd och återställande av biologisk mångfald och ekosystem.

En ekonomisk verksamhet anses vara miljömässigt hållbar om den bidrar väsentligt till ett eller flera av de sex miljömålen, inte orsakar betydande skada för något av de andra fem miljömålen (principen om att **inte orsaka betydande skada**), utförs i överensstämmelse med de minimiskyddsåtgärder som fastställs i artikel 18 i taxonomiförordningen och överensstämmer med tekniska granskningskriterier som har fastställts av kommissionen i enlighet med taxonomiförordningen.

Principen om att inte orsaka betydande skada är endast tillämplig på de av de aktuella delfondernas underliggande investeringar som beaktar Europeiska unionens kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av de aktuella delfondernas underliggande investeringar beaktar inte EU:s kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

De delfonder som identifieras som artikel 8 eller artikel 9 i respektive delfondsbeskrivning kan åta sig eller inte åta sig att investera på datumet för detta prospekt i ekonomiska verksamheter som bidrar till de miljömål som anges i artikel 9 i taxonomiförordningen.

Mer information om Amundis metod för taxonomiförordningen finns i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt och Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

Kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288 av den 6 april 2022

Den 6 april 2022 publicerade Europeiska kommissionen sina tekniska standarder för tillsyn på nivå 2 enligt både förordningen om hållbarhetsupplysningar och taxonomiförordningen. Tekniska standarder för tillsyn åtföljdes av fem bilagor, som innehåller mallar för obligatoriska upplysningar.

Tekniska standarder för tillsyn är en konsoliderad uppsättning tekniska standarder som ger ytterligare information om innehållet, metoden och presentationen av vissa befintliga upplysningskrav enligt förordningen om hållbarhetsupplysningar och taxonomiförordningen.

Kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288, som fastställer de tekniska standarderna för tillsyn, offentliggjordes den 25 juli 2022 i Europeiska unionens officiella tidning (EUT). De tekniska standarderna för tillsyn gäller från den 1 januari 2023.

I enlighet med artikel 14. (2) i de tekniska standarderna för tillsyn finns information om miljörelaterade eller sociala egenskaper för delfonder enligt artikel 8 finns i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

I enlighet med artikel 18. 2 i de tekniska standarderna för tillsyn, information om hållbara investeringar i delfonder enligt artikel 9, om tillämpligt, finns i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Mer information om hur en delfond uppfyller kraven i förordningen om hållbarhetsupplysningar, taxonomiförordningen och de tekniska standarderna för tillsyn finns i aktuell delfondsbeskrivning, fondens årsredovisning och i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Minimistandarder och uteslutningar

Sedan Amundi-koncernen (”Amundi”) bildades har ansvarsfulla investeringar och företagsansvar varit en av grundpelarna, vilket bygger på övertygelsen om att ekonomiska och finansiella aktörer har ett stort ansvar för ett hållbart samhälle och att ESG är en långsiktig drivkraft för finansiella resultat.

Amundi anser att förutom ekonomiska och finansiella aspekter möjliggör integreringen av ESG-dimensionerna i investeringsbeslutsprocessen, däribland hållbarhetsfaktorer och hållbarhetsrisker, en mer omfattande bedömning av investeringsrisker och investeringsmöjligheter.

Amundis integrering av hållbarhetsrisker

Amundis metod för hållbarhetsrisker bygger på tre pelare: en riktad uteslutningspolicy, integrering av ESG-betyg i investeringsprocessen och förvaltning.

För aktivt förvaltade delfonder tillämpar Amundi därför riktade uteslutningspolicyer på alla Amundis aktiva investeringsstrategier genom att utesluta företag som strider mot policyn för ansvarsfulla investeringar, t.ex. sådana som inte respekterar internationella konventioner, internationellt erkända ramar eller nationella bestämmelser.

För passivt förvaltade delfonder utesluter Amundi tillverkare av kontroversiella vapen från de flesta av sina passivt förvaltade delfonder, vilket framgår av varje delfonds beskrivning.
Amundi har också utvecklat en rad passivt förvaltade delfonder som replikerar index som uttryckligen tar hänsyn till hållbarhetsrisker och huvudsakliga negativa konsekvenser på hållbarhetsfaktorer i sina metoder.

För denna specifika grupp av passivt förvaltade delfonder utesluter förvaltningsprocessen företag som inte är förenliga med policyn för ansvarsfulla investeringar som beskrivs nedan, t.ex. sådana som inte respekterar internationella konventioner, internationellt erkända ramar eller nationella bestämmelser.

Dessutom har Amundi utvecklat en egen strategi för ESG-betygsättning. Amundis ESG-betyg strävar efter att mäta en emittents ESG-resultat, dvs. dess förmåga att förutse och hantera hållbarhetsrisker och möjligheter förknippade med dess bransch och enskilda omständigheter.

Amundis ESG-betygsprocess är baserad på metoden bäst i klassen. Betygen är anpassade till varje verksamhetssektor och strävar efter att bedöma den dynamik i vilken företagen verkar.

ESG-betyg och analys utförs inom Amundis ESG-analysteam, som även används som oberoende och kompletterande underlag till beslutsprocessen.

Amundis ESG-betyg är en kvantitativ ESG-poäng som översatts till sju betyg, från A (det högsta betyget) till G (det lägsta betyget). I Amundis ESG-betygsskala motsvarar de värdepapper som hör till uteslutningslistan ett G.

För emittenter bedöms ESG-resultat i jämförelse med det genomsnittliga resultatet för dess bransch via de tre ESG-dimensionerna:
1. Miljödimension: Denna undersöker en emittents förmåga att kontrollera sin direkta och indirekta miljöpåverkan genom att begränsa sin energiförbrukning, minska sina växthusgasutsläpp, bekämpa resursutarmning och skydda den biologiska mångfalden.
2. Social dimension: Denna bedömer hur en emittent använder sig av två skilda begrepp: emittentens strategi för att utveckla sitt humankapital och respekten för de mänskliga rättigheterna i allmänhet.
3. Bolagsstyrningsdimensionen: Denna bedömer emittentens förmåga att säkerställa grunden för en effektiv bolagsstyrningsram och generera värde på lång sikt.

Den metod som tillämpas av Amundis ESG-betyg använder 38 kriterier som antingen är generiska (gemensamma för alla företag oavsett deras verksamhetstyp) eller sektorspecifika som är viktade enligt sektor och som beaktas i fråga om inverkan på en emittents anseende, operativa effektivitet och bestämmelser. Amundis betygsmetod för statliga emittenter förlitar sig på en uppsättning på cirka 50 kriterier som enligt Amundis ESG-analysteam är relevanta för att hantera hållbarhetsrisker och hållbarhetsfaktorer.

Mer information om de 38 kriterier som Amundi beaktar finns i policyn för ansvarsfulla investeringar och Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

Amundis ESG-betyg beaktar även potentiella negativa konsekvenser av emittentens verksamhet för hållbar utveckling (investeringsbeslutsbeslut huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, enligt vad som fastställs av Amundi), inklusive följande indikatorer:
- Utsläpp av växthusgaser och energiprestanda (kriterier för utsläpp och energianvändning)
- Biologisk mångfald (kriterier för avfall, återvinning, biologisk mångfald och föroreningar och ansvarsfull skogsförvaltning)
- Vatten (vattenkriterier)
- Avfall (kriterier om avfall, återvinning, biologisk mångfald och föroreningar)
- Sociala frågor och personalfrågor (kriterier för samhällsengagemang och mänskliga rättigheter, kriterier för anställningsförfaranden, kriterier för styrelsestruktur, kriterier för arbetsmarknadsrelationer och kriterier för hälsa och säkerhet)
- Mänskliga rättigheter (kriterier för samhällsengagemang och mänskliga rättigheter)
- Bekämpning av korruption och mutor (etiska kriterier)

Förvaltning är en integrerad del av Amundis ESG-strategi. Amundi har utvecklat en aktiv förvaltning genom engagemang och röstning. Amundis engagemangspolicy gäller för alla Amundis fonder och ingår i policyn för ansvarsfulla investeringar.

Närmare information finns i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar och i Amundis Sustainable Finance Statement som finns på www.amundi.com

För delfonder som följer index uppmärksammas investerarna på att förvaltningsåtagandet och den rättsliga skyldigheten i passiv förvaltning är att replikera ett index så nära som möjligt.

Därför måste investeringsförvaltaren uppfylla avtalets mål att leverera en passiv exponering i enlighet med det replikerade indexet.

Till följd av detta kan investeringsförvaltarna behöva investera och/eller förbli investerade i värdepapper som ingår i ett index och påverkas av allvarliga kontroverser, akuta hållbarhetsrisker eller väsentliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som kan leda till en uteslutning från Amundis aktivt förvaltade produkter eller ESG ETF/indexprodukter.

Om du vill överväga ett ESG-alternativ hittar du ett brett urval av alternativ inom vårt utbud av ansvarsfulla investeringar.

Hållbarhetsriskers effekter på en delfonds avkastning

Trots integreringen av hållbarhetsrisker i delfondernas investeringsstrategier som beskrivs ovan och i Amundi ESG Regulatory Statement kommer vissa hållbarhetsrisker inte att begränsas.

Kvarstående hållbarhetsrisker som inte begränsats på emittentnivå kan, under perioder som även kan vara långsiktiga, leda till ett lägre ekonomiskt resultat för vissa innehav i delfonderna. Beroende på delfondernas exponering mot de berörda värdepapperen kan kvarstående hållbarhetsrisker som inte begränsats påverka delfondens ekonomiska resultat med varierande allvarlighetsgrad.

Integrering av Amundis metod för hållbarhetsrisker på delfondsnivå

De delfonder som anges nedan klassificeras i enlighet med artikel 8 i förordningen om hållbarhetsupplysningar och strävar efter att främja miljörelaterade eller sociala egenskaper och att investera i företag som följer praxis för god styrning.

Amundi CAC 40 ESG
AMUNDI DAX 50 ESG
Amundi MSCI EMU Screened
Amundi EUR Corporate Bond 0-1Y ESG
Amundi EUR Corporate Bond 1-5Y ESG
Amundi EUR Floating Rate Corporate Bond ESG
Amundi EUR High Yield Corporate Bond ESG
Amundi EUR Short Term High Yield Corporate Bond ESG
Amundi USD High Yield Corporate Bond ESG
Amundi USD Floating Rate Corporate Bond ESG
Amundi USD Corporate Bond Climate Paris Aligned
Amundi Global Government Tilted Green Bond
Amundi STOXX Europe 600 ESG
Amundi PEA MSCI USA ESG Selection
Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI World ESG Broad Transition
Amundi MSCI USA SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI USA ESG Selection
Amundi MSCI UK IMI SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI Smart Cities
Amundi MSCI Robotics & AI
Amundi EUR Corporate Bond 0-3Y ESG
Amundi MSCI Pacific Ex Japan SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI Pacific ESG Broad Transition
Amundi MSCI North America ESG Broad Transition
Amundi MSCI Japan SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI Japan ESG Broad Transition
Amundi MSCI Europe SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI Europe Small Cap ESG Broad Transition

Amundi MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad Transition
Amundi MSCI Europe ESG Broad Transition
Amundi MSCI Europe Climate Paris Aligned
Amundi MSCI EMU SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI EMU Small Cap ESG Broad Transition
Amundi MSCI EMU ESG Selection
Amundi MSCI EMU ESG Broad Transition
Amundi MSCI EMU Climate Paris Aligned
Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Broad Transition
Amundi MSCI Emerging Ex China ESG Selection
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Selection
Amundi MSCI EM Asia SRI Climate Paris Aligned
Amundi MSCI EM Asia ESG Broad Transition
Amundi MSCI China Tech
Amundi MSCI China ESG Selection
Amundi MSCI Ac Far East Ex Japan ESG Selection (till den 14 oktober 2026) Amundi MSCI Emerging Markets Screened (från och med den 15 oktober 2026)
Amundi MDAX ESG
Amundi Lifecycle 2039
Amundi Lifecycle 2036
Amundi Lifecycle 2033
Amundi Lifecycle 2030
Amundi Italy MIB ESG
Amundi USD Corporate Bond ESG
Amundi EUR Corporate Bond ESG
Amundi Euro Aggregate Bond ESG
Amundi Global High Yield Corporate Bond ESG
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y Highest Rated ESG
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG
Amundi Global Bioenergy
Amundi Global Aggregate Bond 1-5Y ESG
Amundi Global Aggregate Bond ESG
Amundi Euro High Yield Bond ESG
Amundi Euro Government Tilted Green Bond
Amundi Euro Government Low Duration Tilted Green Bond
Amundi MSCI Europe Screened
Amundi EUR Cash Active
Amundi EUR Cash Active

De delfonder som anges ovan utesluter, om inte annat anges i förvaltningsprocessen, alla emittenter upptagna i uteslutningslistan i policyn för ansvarsfulla investeringar, så som beskrivet ovan.

SICAV-fonden har för närvarande inte delfonder som har hållbar investering som sitt mål i enlighet med artikel 9 i förordningen om hållbarhetsupplysningar.

I enlighet med Amundis globala policy för ansvarsfulla investeringar integrerar slutligen investeringsförvaltarna av alla andra delfonder, som inte klassificeras enligt artikel 8 eller 9 i förordningen om hållbarhetsupplysningar, om inte annat anges i aktuell delfondsbeskrivning, hållbarhetsrisker i sina investeringsprocesser åtminstone via en förvaltningsmetod och potentiellt beroende på deras investeringsstrategi och tillgångsklasser även via en riktad uteslutningspolicy.

Huvudsakliga negativa konsekvenser

Huvudsakliga negativa konsekvenser är negativa, betydande eller sannolikt betydande konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som orsakas, förvärras av eller är direkt kopplade till emittentens investeringsbeslut.

För passivt förvaltade delfonder beaktar Amundi huvudsakliga negativa konsekvenser genom en kombination av metoder: uteslutningar, engagemang, röstning, övervakning av kontroverser. För delfonder som klassificeras enligt artikel 8 och artikel 9 i förordningen om hållbarhetsupplysningar finns information om beaktande av huvudsakliga negativa konsekvenser i det särskilda avsnittet i den aktuella bilagan med upplysningar som lämnas innan avtal ingås till detta prospekt.

För alla andra delfonder som inte klassificeras enligt artikel 8 eller artikel 9 i förordningen om hållbarhetsupplysningar beaktar Amundi endast indikator nr 14 (Exponering mot kontroversiella vapen (antipersonella minor, klusterammunition, kemiska vapen och biologiska vapen)) i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn och därför beaktar sådana delfonder investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer i investeringsprocessen genom att utesluta värdepapper från företag som är involverade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen, om inte annat anges i aktuell delfondsbeskrivning.

Information om huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer finns i SICAV-fondens årsrapport och i Amundis Sustainable Finance Statement på www.amundi.com

Taxonomi

Om inget annat anges i aktuell delfondsbeskrivning integrerar investeringsförvaltarna av alla delfonder ett beaktande av miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i aktuell delfonds förvaltningsprocess.
I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att delfondernas underliggande investeringar inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer

Den 14 maj 2024 publicerade Esma riktlinjerna för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer (”**riktlinjerna**”).

De trädde i kraft den 21 november 2024 för nya delfonder och kommer att träda i kraft den 21 maj 2025 för delfonder som skapades den 21 november 2024 eller tidigare.

Deras mål är att skydda investerare mot vilseledande delfondsnamn som kan innehålla felaktiga hållbarhetsanspråk och ge vägledning till fondförvaltare om vilka ESG- och hållbarhetsrelaterade namn de kan använda till sina fonder.

Alla delfonder som omfattas av riktlinjerna måste följa nedanstående två regler, nämligen:

– Minst 80 % av deras investeringar används för att uppfylla miljörelaterade eller sociala egenskaper vid artikel 8-delfonder eller mål för hållbar investering vid artikel 9-delfonder.
– Efterlevnad av uteslutningarna enligt antingen EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet eller EU-referensvärden för klimatomställning.

Ytterligare skyldigheter anges i riktlinjerna beroende på om delfondens namn innehåller ”transition”, ”impact”, ”sustainable” eller termer som härrör från dessa ord eller en kombination av dem.

Uteslutningarna från EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt artikel 12.1 a–g i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet är:

a) Företag som bedriver verksamhet med anknytning till kontroversiella vapen.
b) Företag som är verksamma inom odling och produktion av tobak.
c) Företag vars verksamhet administratörer av referensvärden anser vara i strid med principerna i FN:s Global Compact-initiativ (UNGC) eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag.
d) Företag som får 1 % eller mer av sina intäkter från prospektering, gruvdrift, utvinning, distribution eller raffinering av stenkol och brunkol.
e) Företag som får 10 % eller mer av sina intäkter från prospektering, utvinning, distribution eller raffinering av oljebränslen.
f) Företag som får 50 % eller mer av sina intäkter från prospektering, utvinning, framställning eller distribution av gasformiga bränslen.
g) Företag som får 50 % eller mer av sina intäkter från elproduktion med en växthusgasintensitet som överstiger 100 g CO2 e/kWh.

Uteslutningarna från EU-referensvärden för klimatomställning enligt artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad

gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet är:

a) Företag som bedriver verksamhet med anknytning till kontroversiella vapen.
b) Företag som är verksamma inom odling och produktion av tobak.
c) Företag vars verksamhet administratörer av referensvärden anser vara i strid med principerna i FN:s Global Compact-initiativ (UNGC) eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

När en delfond följer uteslutningar från EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet har detta angetts i avsnittet om indexmetoden för aktuell delfond och i det relevanta avsnittet i hållbarhetsbilagan.

När en delfond följer uteslutningar från EU-referensvärden för klimatomställning har detta angetts i avsnittet om indexmetoden för aktuell delfond och i det relevanta avsnittet i hållbarhetsbilagan.

RISKBESKRIVNINGAR

Alla investeringar innebär risk. Riskerna med en del av dessa delfonder kan vara förhållandevis höga.

Riskbeskrivningarna nedan motsvarar de riskfaktorer som anges i informationen om delfonderna.

För att riskerna ska förstås rätt i anslutning till en delfonds angivna risker, beskrivs varje risk som för en enskild delfond.

Riskinformationen i detta prospekt är avsedd att ge en uppfattning om de huvudsakliga och väsentliga risker som är förknippade med varje delfond. En delfond kan påverkas av andra risker i detta avsnitt samt risker som inte nämns här, och riskbeskrivningarna i sig är inte avsedda att vara uttömmande.

Alla dessa risker kan medföra att en delfond förlorar pengar, att den utvecklas sämre än någon annan liknande investering, att den uppvisar kraftig volatilitet (upp- och nedgångar i andelsvärdet) eller att den inte lyckas uppfylla sitt mål under en viss period.

RISKER VID NORMALA MARKNADSFÖRHÅLLANDEN

De risker som ingår i detta avsnitt förekommer i allmänhet i väsentlig grad under normala marknadsförhållanden men tenderar också att vara närvarande – och mer kraftfulla – under ovanliga marknadsförhållanden.

Risk med jämförelseindexets och delfondens resultat för aktivt förvaltade delfonder

Investerare bör observera att delfonder vars mål är att överträffa ett visst jämförelseindex genom att tillämpa en aktiv förvaltningsprocess vid vissa tillfällen kommer att uppnå en avkastning med stora likheter med det aktuella jämförelseindexet på grund av olika omständigheter, bland annat ett smalt investeringsområde som erbjuder mer begränsade möjligheter vad gäller förvärv av värdepapper jämfört med vad som representeras i jämförelseindexet, vald nivå av riskexponering beroende på marknadsförhållanden eller miljö, en portfölj med bred spridning som investerar i ett stort antal värdepapper eller aktuella likviditetsförhållanden.

Risker med tokeniserade andelar

Andelar som emitteras, inlöses, överlåts, innehas eller registreras på en blockkedja är förenade med särskilda risker. Dessa omfattar, men är inte begränsade till, följande potentiella risker:

Regelverket kring blockkedjetekniken utvecklas snabbt, vilket kan ge upphov till problem med säkerhet, dataskydd och andra frågor. Detta kan innebära att man måste ändra hur transaktioner med andelar registreras.

Det kan finnas okända tekniska sårbarheter i registrerings- och överlåtelseombudets blockkedjesystem eller i en underliggande teknik, bland annat när det gäller hur transaktioner registreras i en blockkedja, hur giltigheten av blockkedjekopior kan bevisas med hjälp av distribuerad databasteknik eller processerna för att skydda och säkra privata nycklar.

Kryptografiska eller andra säkerhetsmekanismer som verifierar tidigare transaktioner i en blockkedja kan utsättas för intrång eller hackas, vilket kan göra det möjligt för en cyberangripare att ändra blockkedjan och störa verifieringen av de slutgiltiga transaktioner som registrerats i den.

Nya tekniker eller tjänster kan begränsa eller blockera tillgången till en blockkedja.

Ett säkerhetsintrång eller ett fel i en blockkedja kan undergräva investerarnas förtroende för blockkedjetekniken, vilket kan leda till en minskad benägenhet att utfärda och investera i blockkedjebaserade tillgångar.

Transaktionshantering i de blockkedjenätverk som används av SICAV-fonden och registrerings- samt överlåtelseombudet kan drabbas av förseningar. Sådana förseningar kan bero på olika faktorer, bland annat att datorerna (”noder”) inte lyckas nå konsensus om väntande transaktioner. När sådana förseningar uppstår kan det vara omöjligt att registrera andelstransaktioner på blockkedjan i realtid. Om dessa störningar fortsätter kan SICAV-fonden välja att hantera andelsägarnas transaktioner manuellt med hjälp av traditionella registreringsmetoder tills blockkedjenätverket fungerar normalt igen.

Emission, inlösen, överlåtelse och registrering av andelar som registreras i en DLT innebär att token skapas genom automatiserade datorprotokoll (så kallade smarta kontrakt). Användningen av DLT, tokens och tillhörande smarta kontrakt kan innebära risker för investerare på grund av olika faktorer, till exempel att dessa tekniker är relativt nya, den utveckling de kan genomgå, tekniska fel och/eller cyberattacker. Tillämpliga regler och begränsningar kan ändras eller utvecklas över tid. Dessa risker kan tillfälligt påverka emissioner, inlösen och överlåtelsen av andelar i en tokeniserad andelsklass.

På grund av de stora skillnaderna mellan att utfärda och registrera andelar i en blockkedja jämfört med i traditionella register kan vissa problem som normalt sett är enkla att hantera inom befintliga rättsliga och operativa ramar visa sig vara mer komplexa eller oprövade när det gäller blockkedjebaserade andelar. Som en åtgärd för att begränsa riskerna planerar registrerings- och överlåtelseombudet att även registrera de blockkedjebaserade transaktionerna i de register som förs med hjälp av en standardteknik.

Eventuella problem eller tvister som uppstår i samband med användningen av blockkedjeteknik kan inverka negativt på SICAV-fondens nuvarande verksamhet eller framtida aktiviteter.

Avancerad informationsteknik och kommunikationssystem – såsom blockkedjeinfrastruktur – är i sig utsatta för en rad risker och sårbarheter som kan påverka SICAV-fonden, trots att SICAV-fondens och registrerings- och överlåtelseombudet har infört skyddsåtgärder och riskbegränsande strategier. Om en sådan risk skulle bli verklighet kan SICAV-fonden drabbas av betydande ekonomiska förluster. Dessa incidenter kan även leda till granskning från myndigheternas sida, eventuella sanktioner eller rättsliga anspråk. Vidare kan perioder med hög marknadsaktivitet generera transaktionsvolymer som överstiger kapaciteten hos befintliga system, vilket kan få SICAV-fonden att fungera mindre effektivt.

Blockkedjans huvudbok är offentligt tillgänglig och innehåller en fullständig historik över transaktioner från den tidpunkt då andelarna emitterades. Därför kan omfattande och transparent transaktionsdata – utan någon personlig identifierbar information om andelsägare – ses via blockkedjeutforskare. Information om emission och inlösen av andelar är kryptografiskt skyddad, och endast den publika adressen, som härleds från en offentlig nyckel, är synlig för allmänheten. Personuppgifter som krävs för att matcha en plånboks offentliga nyckel med motsvarande andelsägare lagras säkert i en separat, icke-offentlig databas som förvaltas av registrerings- och överlåtelseombudet. Om det skulle inträffa ett säkerhetsintrång som omfattar denna databas, och äventyra data som kopplar plånboksadresser till enskilda individer, då skulle det potentiellt kunna ge en illvillig aktör möjlighet att avslöja en andelsägares identitet och transaktionshistorik inom SICAV-fonden.

På grund av dessa risker är det möjligt att de berörda andelsklasserna inte antas brett på marknaden eller samlar på sig betydande tillgångar. Under sådana omständigheter kan SICAV-fonden överväga olika strategiska alternativ, till exempel att omstrukturera eller avveckla den berörda andelsklassen, eller att registrerings- och överlåtelseombudet upphör att använda det blockkedjebaserade systemet och återgår till att använda den vanliga bokföringsmetoden.

Andelsägare i delfondens tokeniserade andelsklass kan när som helst byta till en icke-tokeniserad andelsklass inom samma delfond.

Eftersom andelarna registreras i en DLT (distribuerad databasteknik) representeras de tekniskt sett som token. Dessa token måste förvaras på ett säkert sätt och kan endast

överföras via en nybildad plånbok skapad av registrerings- och överlåtelseombudet, som tilldelas investeraren, eller via en befintlig plånbok som ska granskas och godkännas av registrerings- och överlåtelseombudet. En investerare måste säkerställa följande: (a) att plånboken är kompatibel med den DLT som används för att uppdatera andelsägarregistret, (b) att informationen som lämnas till registrerings- och överlåtelseombudet angående plånboken är korrekt, (c) att användningen av plånboken och den enhet som driver den efterlever gällande lagar och regler, (d) att plånboken är säker och (e) att åtkomstmetoderna som möjliggör tokenöverföringar (särskilt plånbokens privata nyckel) hålls hemliga. Alla faktorer som påverkar dessa skyldigheter kan ha inverkan på emission, inlösen och överlåtelse av de berörda andelarna, vilket kan leda till en partiell eller total förlust av investeringen. Potentiella investerare uppmanas att sätta sig in i de tekniska aspekterna av de tokeniserade andelsklasserna innan de investerar.

Andelsägare bör vara medvetna om att om en privat nyckel stjäls eller förloras, så är vanligtvis plånboken utsatt och alla digitala tillgångar som är kopplade till den kan bli otillgängliga för innehavaren och/eller drabbas av olaglig förskingring.

Koncentrationsrisk
I den mån delfonden investerar en stor del av sina tillgångar i ett begränsat antal branscher, sektorer eller emittenter, eller inom ett begränsat geografiskt område, kan den vara mer riskfylld än en fond som investerar bredare.

När en delfond investerar en stor del av sina tillgångar i en viss emittent, bransch, typ av obligation, land eller region, eller i en rad nära sammanlänkade ekonomier, kommer dess resultat att påverkas kraftigare av affärsrelaterade, ekonomiska, finansiella, marknadsmässiga eller politiska förhållanden som påverkar koncentrationsområdet. Detta kan innebära både högre volatilitet och större risk för förlust.

Landrisk – Kina
I Kina är det osäkert om en domstol skulle skydda delfondens rätt till värdepapper som den kan köpa. En delfond kan investera på kinesiska marknader via flera program, vars bestämmelser är oprövade och kan ändras. Tillämpningen och tolkningen av sådana investeringsbestämmelser är relativt oprövad och det är osäkert hur de kommer att tillämpas, och det finns inget prejudikat eller säkerhet beträffande hur de kinesiska myndigheterna och tillsynsmyndigheterna kan utöva sin stora handlingsfrihet nu eller i framtiden.

För investering i kinesiska aktier kan en delfond investera via Stock Connect (Shanghai-Hong Kong Stock Connect och/eller Shenzhen-Hong Kong Stock Connect) eller andra program. Stock Connect är ett nytt handelsprogram som kopplar samman aktiemarknader i Kina och Hongkong och kan omfattas av ytterligare riskfaktorer. Stock Connect omfattas av kvotbegränsningar, vilket kan begränsa en delfonds möjligheter att handla via Stock Connect i tid. Strukturen på dessa program kräver inte fullständig ansvarsskyldighet för några av sina komponenter och ger investerare som delfonden förhållandevis små möjligheter att vidta rättsliga åtgärder i Kina. Dessutom kan värdepappersbörserna i Kina beskatta eller begränsa korttidshandel, återkalla godtagbara aktier, fastställa maximala handelsvolymer (på investerarnivå eller på marknadsnivå) eller på annat sätt begränsa eller fördröja handeln.

För investering i kinesiska obligationer kan en delfond investera via direkt tillgång till China Interbank Bond Market (CIBM) och Bond Connect North Bound. Vissa av delfonderna kan sträva efter exponering mot räntebärande värdepapper i RMB utan särskild licens eller kvot direkt på CIBM via ett inhemskt obligationsbetalningsombud eller Bond Connect North Bound. CIBM Direct Access och Bond Connect North Bound är relativt nya regler och bestämmelser. Vissa begränsningar kan åläggas av myndigheterna för investerare som deltar i CIBM Direct Access och/eller obligationsbetalningsombudet och/eller Bond Connect North Bound och/eller underförvaringsinstitutet som kan ha en negativ inverkan på delfondens likviditet och resultat.

Täckt köpoption
Strategier som bygger på att sälja täckta köpoptioner genererar intäkter från premien, men begränsar samtidigt eventuella vinster över lösenpriset, vilket kan leda till att utvecklingen blir sämre än för det underliggande indexet. Även om de insamlade premierna delvis kan kompensera förluster på nedåtgående marknader, räcker de i regel inte till för att helt skydda mot stora marknadsnedgångar.

Implicit volatilitet
Det är marknadens förväntningar på hur mycket det underliggande priset kommer röra sig under det kommande året. Förändringar i den implicita volatiliteten påverkar direkt optionskurserna och de premier som strategin kan generera.

En hög implicit volatilitet innebär att optionerna blir dyrare. En låg implicit volatilitet kan minska intäkterna, medan plötsliga uppgångar i den implicita volatiliteten kan leda till stora marknadsvärderingsförluster och högre kostnader för återköp av optioner.

Eftersom strategin upprepade gånger säljer köpoptioner med lösenpris vid nuvarande kurs, kan förlusterna öka snabbt vid stora negativa kursrörelser, medan uppsidan är begränsad till de erhållna premierna. Detta ger endast ett begränsat skydd och garanterar inte de fastställda målintäkterna.

Kreditrisk
En obligation eller ett penningmarknadspapper kan tappa i värde om emittentens finansiella ställning försämras.
Om den finansiella ställningen försämras – eller om marknaden tror att den försämras – för en emittent som utfärdat en obligation eller ett penningmarknadsinstrument kan värdet på obligationen eller penningmarknadspappret sjunka. Ju lägre kreditkvalitet på skuldförbindelsen, desto större kreditrisk.
I vissa fall kan en enskild emittent hamna på obestånd (se ”Fallissemangsrisk” under ”Risker vid ovanliga marknadsförhållanden”), även om vanliga förhållanden råder på den allmänna marknaden.

Valutarisk
Förändringar i valutakurserna kan minska investeringsvinsterna eller öka investeringsförlusterna, i vissa fall avsevärt. Valutakurserna kan ändras snabbt och oförutsägbart. Investerare är därför utsatta för valutakursrisken mellan valutorna för antingen de underliggande värdepapper som utgör indexet eller delfondens portfölj (enligt vad som är tillämpligt) och valutan för den delfondsandel de investerade i. Valutarisken kan uppgå till 100 % av delfonden.

Förvaltning av säkerheter
Motpartsrisker som uppstår från investeringar i OTC-derivat och värdepappersutlåning och återköpsavtal begränsas vanligtvis genom överföring eller pantsättning av en säkerhet till delfonden. Dock är det inte möjligt att ställa en fullständig säkerhet för transaktionerna. Det är möjligt att det inte går att säkra avgifter och avkastning till delfonden. Om motparten hamnar på obestånd är det möjligt att delfonden måste sälja säkerheter ställda i annan form än kontanter till rådande marknadskurs. Om detta är fallet kan delfonden göra en förlust, som bland annat kan bero på felaktig kurssättning eller övervakning av säkerheten, en negativ marknadsutveckling, att emittentens kreditbetyg har försämrats eller att det råder likviditetsbrist på marknaden där säkerheten handlas. Svårigheter med att sälja säkerheter kan begränsa eller fördröja delfondens möjligheter att uppfylla en säljorder.

En delfond kan även göra förluster vid återinvestering av säkerheter i form av kontanter, när så är tillåtet. En sådan förlust kan uppstå på grund av att värdet på investeringen sjunker. En minskning av värdet på sådana investeringar skulle minska storleken på den tillgängliga säkerheten som ska återlämnas av delfonden till motparten i enlighet med transaktionens avtalsvillkor. Delfonden skulle vara tvungen att täcka värdeskillnaden mellan den ursprungliga säkerheten och det tillgängliga värdet som ska återbetalas till motparten, och som därmed skulle orsaka en förlust för delfonden.

Förvaringsrisk
SICAV-fondens värdepapper innehas i allmänhet till förmån för SICAV-fondens andelsägare på förvaringsinstitutets eller dess underförvaringsinstituts balansräkning, och är i allmänhet inte blandade med förvaringsinstitutets eller underförvaringsinstitutets tillgångar. Detta ger skydd för SICAV-fondens värdepapper i händelse av insolvens hos antingen förvaringsinstitutet eller dess underförvaringsinstitut.

På vissa marknader kan dock en risk uppstå om segregation inte är möjlig, och värdepapperen blandas med underförvaringsinstitutets

tillgångar eller slås samman i en pool med andra kunders värdepapper hos underförvaringsinstitutet. Förlusten skulle då spridas över alla kunder i poolen och skulle inte begränsas till den kund vars värdepapper som var föremål för förlusten.

Derivatrisk
Vissa derivat kan uppträda på ett oväntat sätt eller exponera delfonden mot förluster som vida överstiger kostnaden för derivatet.

Derivat är i allmänhet mycket volatila och ger ingen rösträtt. Priset och volatiliteten för många derivat, särskilt kreditderivat (CDS), kan avvika från priset och volatiliteten i fråga om deras underliggande referenstillgångar. Under svåra marknadsförhållanden kan det vara omöjligt att lägga sådana order som kan begränsa eller kompensera marknadsexponering eller förluster orsakade av derivat.

En delfond kan få begränsad exponering (genom bland annat derivat och andelar i andra företag för kollektiva investeringar) mot emittenter med exponering som kanske inte uppfyller Amundis policy för ansvarsfulla investeringar som anges i avsnittet ”Översikt över policyn för ansvarsfulla investeringar” (”**policyn för ansvarsfulla investeringar**”), kraven på ansvarsfull investering (”**SRI**”) och/eller ESG-kriterier som tillämpas av indexleverantören. Det kan finnas potentiella inkonsekvenser i ESG-kriterierna eller de ESG-betyg som tillämpas av de underliggande kollektiva investeringsprogram som en delfond investerar i.

Fast löptidsrisk
Med tanke på deras mål är delfonder med fast löptid utformade för investerare som förstår arten och de specifika risker som är förknippade med produkter med fast löptid och som planerar att investera fram till förfallodagen. En teckning i dessa delfonder under det sista året av deras respektive löptider kanske inte är lämplig, eftersom de obligationer som ingår i deras respektive index successivt når sin respektive förfallodag under det sista året av deras respektive löptider.

Delfonder med fast löptid investerar i obligationer med en definierad förfallodag. På delfondernas förfallodag, om inte annat beslutas av styrelsen, får andelsägare i delfonder med fast löptid sina aktier inlösta utan ytterligare meddelande eller andelsägargodkännande. I detta fall betalas inlösenlikviden ut till sådana andelsägare vid eller runt förfallodagen. Dessutom kan delfonderna avslutas vid eller runt förfallodagen.

Fondföretagets ETF-andelsklasser av delfonder med fast löptid avnoteras även från alla relevanta börser vid eller runt förfallodagen (med förbehåll för individuella börskrav).

Delfonder med fast löptid avser inte att återbetala något förutbestämt belopp vid förfallodagen eller genom periodiska utdelningar och bör därför inte betraktas som en skulddriven investeringslösning.

Under hela löptiden för en delfond med fast löptid ger sådana delfonder investeringsexponering mot obligationer som har fallande löptid. När obligationerna närmar sig förfallodagen närmar sig kursen i allmänhet det nominella värdet och detta påverkar substansvärdet för denna delfond. Om en obligation handlas över nominellt värde sjunker kursen när den närmar sig förfallodagen och vice versa.

Under de sista 12 månaderna före förfallodagen för en delfond med fast löptid, när de obligationer en sådan delfond investerar i följer indexets löptid, får denna delfond ett ökande belopp av likvida medel från de obligationer som förfaller (med förbehåll för eventuella fallissemang hos emittenter).

I enlighet med tillämplig indexmetod investerar en delfond med fast löptid likvida medel i instrument med återstående löptid efter varje månads ombalanseringsdatum. Som ett resultat av detta är sammansättningen samt risk- och avkastningsprofilen för denna delfond vid star väsentligt annorlunda än sammansättningen samt risk- och avkastningsprofilen för samma delfond under de sista 12 månaderna före förfallodagen.

Investeringar i dessa delfonder med fast löptid bör inte betraktas som ett alternativ till att investera i ett vanligt inlåningskonto. Investeringar i dessa delfonder är inte försäkrade eller garanterade av SICAV, investeringsförvaltaren, dotterbolag eller någon statlig myndighet. Värdet av en investering i delfonder med fast löptid kan fluktuera och en investerare kanske inte får tillbaka hela det investerade beloppet.

Delfonder med fast löptid är avsedda för investerare som avser att inneha investeringen fram till relevant förfallodag. Även om syftet är att ge en liknande avkastning som indexets avkastning, erbjuder delfonder med fast löptid ingen sådan garanti för att detta mål uppnås och investerare kan drabbas av kapitalförlust. I scenarier där investerare vill lösa in sina andelar före förfallodagen kan kapitalförlusten bli större. Delfonder med fast löptid kan också medföra en ökad risk om investerare som representerar betydande andelar av dessa delfonder vill lösa in sina andelar före förfallodagen. Med tanke på den förändrade karaktären hos de tillgångar som innehas under det sista året för delfonder med fast löptid förändras investerarnas risker över tid.

Investerare som investerar under det sista året kan inte dra nytta av den avkastning eller kapitalvinst som de skulle ha fått om de varit investerade under hela perioden.

Skattemässig hantering av investeringar som är specifik för delfonder med fast löptid
Presumtiva investerare bör vara medvetna om att den skattemässiga hantering som är tillämplig enligt lagstiftningen i den eller de jurisdiktioner där de är skattskyldiga kan variera beroende på om de innehar andelar i en delfond med fast löptid tills sådana aktier löses in på förfallodagen eller säljer sina andelar på en auktoriserad börs genom en mäklare och sådan försäljning regleras före förfallodagen.

Indexberäkningsrisk
Delfonderna kan använda och följa index som fastställs, beräknas och underhålls av indexsponsorer. Indexsponsorer kan uppleva operativa risker som kan generera fel när det index som delfonderna använder eller replikerar fastställs, sätts samman eller beräknas, vilket leder till förluster i delfondernas investeringar eller avvikelse från indexmålet enligt beskrivningen i indexmetoden och delfondernas beskrivning och fel när den aktiva risken eller avvikelsen från den investeringsstrategi som följs av delfonderna fastställs.

OTC-derivat
OTC-derivat är kort sagt enskilda överenskommelser mellan en delfond och en eller flera motparter och är svagt reglerade jämfört med värdepapper som handlas på en offentlig marknad. OTC-derivat medför större risk för motparten och likviditetsrisk, och det kan vara svårare att tvinga en motpart att fullgöra sina skyldigheter gentemot en delfond. Listan över motpartsavtal kommer finnas tillgänglig i årsredovisningen. Denna motpartsrisk begränsas av regelgränserna för motparter med OTC-derivat. Begränsningstekniker som syftar till att begränsa denna risk används, till exempel en säkerhetspolicy eller återställningar i OTC-swappar.

Om en motpart upphör att erbjuda ett derivat som en delfond hade planerat att använda kan det vara svårt för delfonden att hitta ett motsvarande derivat någon annanstans. Detta kan resultera i att delfonden går miste om vinster eller att den blir exponerad mot risker eller förluster. Hit hör förluster på grund av en derivatposition för vilken delfonden inte lyckades ta en utjämnande position. Det finns inga garantier för att värdet av de säkerheter som innehas kommer vara tillräckligt för att täcka det belopp som är skyldigt till SICAV-fonden.

För att minska motpartsrisken kommer förvaltningsbolaget att göra ett värderingsavdrag för alla mottagna säkerheter. SICAV-fonden får ingå OTC-derivat som regleras genom en central regleringsmotpart för att minska motpartsrisken och öka likviditeten, men det eliminerar inte dessa risker helt. Den centrala regleringsmotparten kräver marginal från regleringsmäklaren som i sin tur kräver marginal från SICAV-fonden. Det finns en risk för förlust för en SICAV-fond av dess initiala och variationsmarginalinsättningar.

Vissa godtagbara OTC-derivat kan lämnas in för reglering till centrala regleringsmotparter och rapportering av vissa uppgifter till transaktionsregister, och lämpliga förfaranden och åtgärder för att mäta, övervaka och begränsa operativa risker och motpartsrisker kan vidtas med avseende på OTC-derivat som inte är föremål för obligatorisk reglering. Vissa av de lagstadgade skyldigheterna har

inte slutförts på dagen för detta prospekt. Det är svårt att förutsäga deras fulla inverkan på SICAV-fonden, vilket kan omfatta en ökning av de totala kostnaderna för att ingå och upprätthålla OTC-derivat.

Du bör vara medveten om att de tillämpliga lagar som kräver central reglering av OTC-derivat i sinom tid kan ha negativ inverkan på delfondernas förmåga att följa sina respektive placeringsinriktningar och uppnå sitt investeringsmål.
Investeringar i OTC-derivat kan också vara föremål för risk för att olika värderingar uppstår på grund av olika tillåtna värderingsmetoder. Felaktig värdering kan leda till felaktig redovisning av vinster eller förluster och motpartsexponering. Det kan också finnas en rättslig risk eller dokumentationsrisk för att parterna inte har samma syn på en tolkning av villkoren i avtalet. Sådana risker begränsas i allmänhet genom användning av branschstandardavtal.

Eftersom det i allmänhet är opraktiskt för SICAV-fonden att dela upp sina OTC-derivattransaktioner mellan ett stort antal motparter, kan en försämrad finansiell ställning hos en enda motpart orsaka betydande förluster. Om någon fond däremot upplever någon finansiell svaghet eller inte uppfyller en skyldighet, skulle motparterna kunna bli ovilliga att göra affärer med SICAV-fonden, vilket skulle kunna göra att SICAV-fonden inte kan verka effektivt och konkurrenskraftigt.

Börsnoterade derivat
Även om börsnoterade derivat i allmänhet anses medföra lägre risk än OTC-derivat finns det fortfarande risk för att ett avbrott i handeln med derivat eller deras underliggande tillgångar skulle kunna göra det omöjligt för delfonden att realisera vinster eller undvika förluster, vilket i sin tur kan orsaka en försening i hanteringen av inlösen av andelar. Därtill finns en risk att börsnoterade derivat inte kan avräknas i det avsedda systemet vid den tidpunkt och på det sätt som var tänkt.

Risk med tillväxtmarknader
Tillväxtmarknader är mindre etablerade än utvecklade marknader och medför därmed högre risker, särskilt marknads-, likviditets-, valuta- och ränterisker samt risken för högre volatilitet.
Några av förklaringarna till de ökade riskerna:
– politisk, ekonomisk eller social instabilitet
– finanspolitisk misskötsel eller inflationspolitik
– ogynnsamma förändringar i regelverk och lagar och osäkerhet kring deras tolkning

– underlåtenhet att genomdriva lagar eller förordningar, eller att erkänna investerarnas rättigheter på samma sätt som på utvecklade marknader
– alltför höga avgifter, handelskostnader eller skatter, eller godtyckligt beslagtagande av tillgångar
– regler eller praxis som missgynnar utländska investerare
– ofullständig, vilseledande eller felaktig information om emittenter av värdepapper
– brist på enhetliga redovisnings-, revisions- och rapporteringsstandarder
– manipulation av marknadspriser av stora investerare
– oförutsedda förseningar och stängningar på marknaden
– bedrägeri, korruption och misstag.

Tillväxtländer kan begränsa värdepappersinnehav för utlänningar eller ha mindre reglerad förvaringspraxis, vilket gör delfonden mer sårbar för förluster och medför begränsade juridiska möjligheter.

I länder där delfonden, antingen på grund av bestämmelser eller av effektivitetsskäl, använder depåbevis (omsättningsbara certifikat utfärdade av den faktiska ägaren av de underliggande värdepapperen), P-notes eller liknande instrument för att få investeringsexponering, tar delfonden på sig risker som inte föreligger med direktinvesteringar. Dessa instrument omfattar motpartsrisk (eftersom de är beroende av emittentens kreditvärdighet) och likviditetsrisk, och kan handlas till kurser som ligger under värdet på de underliggande värdepapperen, och kan misslyckas med att överlåta till delfonden vissa av de rättigheter (såsom rösträtt) som den skulle ha om den ägde de underliggande värdepapperen direkt.

I den mån tillväxtmarknaderna befinner sig i andra tidszoner än Luxemburg är det möjligt att delfonden inte kan reagera i god tid på kursrörelser som inträffar under timmar när delfonden inte är öppen för affärer.

I risksyfte omfattar kategorin tillväxtmarknader de marknader som är mindre utvecklade, till exempel de flesta länder i Asien, Afrika, Sydamerika och Österuropa, samt länder som har framgångsrika ekonomier men som kanske inte erbjuder samma nivå av investerarskydd som finns i exempelvis Västeuropa, USA och Japan.

Aktierisk
Värdet på aktier kan sjunka snabbt och förbli på låga nivåer under obegränsad tid, och det innebär i allmänhet högre risker än med obligationer eller penningmarknadsinstrument. Aktier i snabbt växande företag kan vara mycket känsliga för dåliga nyheter, eftersom mycket av deras värde bygger på höga förväntningar inför framtiden. Aktier i företag som verkar prissättas under sitt värde kan fortsätta att vara undervärderade.
Om ett företag går i konkurs eller blir föremål för liknande finansiell omstrukturering kan aktierna förlora hela eller delar av sitt värde.

Säkringsrisk
Eventuella försök att minska eller undanröja risker kanske inte får avsedd effekt. Och i den mån åtgärderna fungerar innebär de ofta att minskad risk för förlust går hand i hand med minskad vinstpotential.

Åtgärder som delfonden vidtar i syfte att förhindra specifika risker kanske inte alltid fungerar som det var tänkt, är inte alltid praktiskt möjliga eller kan misslyckas helt. I den mån det inte finns någon säkring kommer delfonden eller andelsklassen att utsättas för alla risker som säkringen skulle ha skyddat mot.

Delfonden kan använda säkring inom sin portfölj. När det gäller eventuella specifikt utsedda andelsklasser kan delfonden säkra klassens valutaexponering (i förhållande till delfondens underliggande investeringar) eller klassens valutaexponering i förhållande till delfondens valuta. Investerare bör vara medvetna om att denna strategi i väsentlig grad kan begränsa möjligheten för andelsägare i den berörda säkrade andelsklassen att dra nytta av en försvagning av den valuta som andelsklassen är noterad i, jämfört med den eller de valutor som delfondens investeringar är noterade i. Under sådana omständigheter kan andelsägare i den berörda säkrade andelsklassen i delfonden utsättas för fluktuationer i substansvärdet per andel som återspeglar vinster eller förluster och kostnader för derivaten i fråga. Derivat som används för att genomföra sådana strategier ska inte utgöra tillgångar eller skulder för delfonden som helhet. Vinster eller förluster samt kostnader för de berörda finansiella instrumenten tillfaller emellertid uteslutande den berörda säkrade andelsklassen i delfonden.
När det gäller en andelsklass som inte är säkrad kommer värdet på andelarna, uttryckt i andelsklassens valuta, att vara utsatt för valutarisk i förhållande till den relevanta basvalutan eller de valutor i vilka tillgångarna i den aktuella delfonden är noterade.

Risk för illikvida värdepapper
Vissa värdepapper kan till sin natur vara svåra att värdera eller sälja vid önskat tillfälle samt till önskat pris och volym.
Detta omfattar värdepapper som är betecknade som illikvida, såsom värdepapper som uppfyller regel 144A, samt ett värdepapper av alla slag som representerar en liten emission, handlas sällan eller handlas på marknader som är jämförelsevis små eller som har långa avvecklingstider.

Risk med investeringsfond
Som med alla investeringsfonder innebär en investering i delfonden vissa risker som investeraren inte skulle utsättas för vid en direktinvestering i marknaden:

– Andra investerares agerande, särskilt plötsliga stora utflöden av likvida medel, skulle kunna påverka förvaltningen av delfonden under ordnade former och få dess substansvärde att minska.
– Investeraren kan inte styra eller påverka hur delfondens medel investeras.
– Delfondens köp och försäljningar av investeringar kanske inte är skattemässigt optimala för alla enskilda investerare.
– Delfonden lyder under en rad investeringslagar och bestämmelser som begränsar möjligheten att använda vissa värdepapper och investeringstekniker som skulle kunna förbättra resultatet. Om förvaltarna bestämmer sig för att delfonden ska registreras i jurisdiktioner med ännu striktare regler kan det begränsa delfondens investeringsmöjligheter

ytterligare.

- Delfonden är baserad i Luxemburg, och det är därför inte säkert att den har tillgång till sådana skydd som skulle ha gällt i andra jurisdiktioner utanför Luxemburg.
- Eftersom vissa av delfondens andelar handlas på primärmarknaden eller inte handlas offentligt, är den enda möjligheten att likvidera andelar i allmänhet inlösen, vilket kan bli föremål för förseningar och andra inlösenpolicyer som fastställs av delfonden.
- I den mån delfonden investerar i andra fondföretag och företag för kollektiva investeringar kan den komma att ådra sig ett andra lager av investeringsavgifter, vilket ytterligare kommer att urholka eventuella investeringsvinster.
- I den mån delfonden använder effektiva metoder för portföljförvaltning, som utlåning av värdepapper, upplåning av värdepapper, återköpstransaktioner och omvända återköpstransaktioner samt TRS, och i synnerhet om delfonden återinvesterar säkerheter som är förknippade med dessa tekniker, tar den på sig motpartsrisk, likviditetsrisk, rättslig risk, förvaringsrisk (t.ex. avsaknad av separation av tillgångar) och operativa risker, som kan påverka delfondens resultat. I den mån närstående parter (företag i samma grupp som förvaltningsbolaget eller som investeringsförvaltaren eller som underförvaltaren) kan medverka som motpart eller ombud (eller i någon annan roll) i en effektiv portföljförvaltning, och särskilt i värdepappersutlåning, kan en potentiell intressekonflikt uppstå.
  Förvaltningsbolaget ansvarar för att hantera eventuella konflikter som kan uppstå och undvika att sådana konflikter påverkar andelsägarna negativt. Alla intäkter som uppstår genom återköpstransaktioner och transaktioner för värdepappersfinansiering ska återbetalas till berörd delfond efter avdrag för eventuella direkta eller indirekta operativa kostnader och avgifter. Sådana direkta och indirekta driftskostnader och avgifter, som inte ska omfatta dolda intäkter, ska omfatta avgifter och kostnader som ska betalas till ombud eller motparter till normala kommersiella priser. Amundi-koncernens policy för förebyggande och hantering av intressekonflikter finns på Amundis webbplats (www.amundi.com eller www.amundietf.com).
- Investeringsförvaltaren eller dess utsedda personer kan ibland hamna i en situation då deras skyldigheter gentemot delfonden strider mot deras skyldigheter gentemot andra investeringsportföljer som de förvaltar (även om alla portföljer i sådana fall hanteras rättvist).

Risk med högavkastande instrument
Eventuella försök att minska eller undanröja risker kanske inte får avsedd effekt. Och i den mån åtgärderna fungerar innebär de ofta att minskad risk för förlust går hand i hand med minskad vinstpotential.

Åtgärder som delfonden vidtar i syfte att förhindra specifika risker kanske inte alltid fungerar som det var tänkt, är inte alltid praktiskt möjliga eller kan misslyckas helt. I den mån det inte finns någon säkring kommer delfonden eller andelsklassen att utsättas för alla risker som säkringen skulle ha skyddat mot.

Delfonden kan använda säkring inom sin portfölj. När det gäller vissa angivna andelsklasser kan delfonden säkra klassens valutaexponering (i förhållande till portföljens referensvaluta eller till valutaexponeringen i berörd delfonds portfölj). Risksäkring är förenat med kostnader som minskar investeringens avkastning.

Ränterisk
Högavkastande skuldebrev omfattar särskilda överväganden och risker, inklusive de risker som är förknippade med internationella investeringar i allmänhet, såsom valutafluktuationer, riskerna med att investera i länder med mindre kapitalmarknader, begränsad likviditet, prisvolatilitet och restriktioner för utländska investeringar. Investeringar i högavkastande skuldebrev är föremål för risker med ränta, valuta, marknad, kredit och säkerhet. Jämfört med obligationer på investment grade är högavkastande obligationer normalt lägre värderade värdepapper, och kommer vanligtvis erbjuda högre avkastning för att kompensera för den minskade kreditvärdighet eller ökade risk för fallissemang som dessa värdepapper bär.

Ränterisk
När räntan stiger sjunker vanligtvis värdet på obligationen. Ju längre löptid obligationen har, desto större är risken.

Risk med låg ränta
När räntan är låg kanske avkastningen på penningmarknadsinstrument och andra kortfristiga instrument inte är tillräcklig för att täcka delfondens förvaltnings- och driftskostnader, vilket leder till en minskning av delfondens värde.

Risk med penningmarknadsfonder
En penningmarknadsfond är inte samma sak som inlåning. En penningmarknadsfond är inte en garanterad investering och det kapitalbelopp som investeras i en penningmarknadsfond kan komma att fluktuera. Därför ska risken för förlust av kapitalbeloppet bäras av andelsägarna. Slutligen förlitar sig fonden inte på externa tillskott för att garantera penningmarknadsfondens likviditet eller stabilisera substansvärdet per andel.

Risk med indexreplikering
Delfonderna följer index som replikerar resultatet av underliggande värdepapper vars kurser förändras kontinuerligt, och kan falla baserat på en mängd olika faktorer. På grund av delfondernas mål att följa index kommer delfondernas resultat att följa resultatet för det specifika indexet, oavsett om resultatet stiger eller faller.

Indirekt replikering – Konsekvenser av exponering mot indexet och motpartsrisken
När exponeringen för delfonden mot indexet endast är indirekt (eller swap-baserad), innebär det att delfonden strävar efter att replikera resultatet för indexet genom att investera i finansiella derivatinstrument snarare än genom att direkt inneha indexets underliggande värdepapper.

Att ingå finansiella derivatinstrument som ett swapavtal kommer inte att göra delfonden till en innehavare av eller ge delfonden direkt investeringsposition i något av de underliggande indexvärdepapperen eller någon komponent som ingår däri. Delfonden kommer inte att ha några rättigheter med avseende på de underliggande indexvärdepapperen.

Därför kommer alla belopp som ska betalas för andelar i delfonden att betalas kontant och investerare kommer inte ha några rättigheter att erhålla leverans av något underliggande indexvärdepapper (se avsnittet ”SEKUNDÄR MARKNAD FÖR UCITS ETF-ANDELAR”).

Delfonden kommer att utsättas för en kreditrisk för de motparter med vilka den handlar i förhållande till OTC-derivat som används för att replikera indexets resultat, såsom swapavtal. Sådana derivat ges inte samma skydd som kan gälla för derivat som handlas och regleras på börser. Motparten för OTC-derivaten kommer att vara det specifika företag eller firma involverad i transaktionen, snarare än en erkänd börs; och följaktligen kan insolvens, konkurs eller betalningsinställelse för en motpart med vilken en delfond handlar ett sådant OTC-derivat resultera i betydande förluster för delfonden. Dessutom är det under exceptionella omständigheter möjligt att motparten för OTC-derivaten inte kan fullgöra sina skyldigheter gentemot delfonden på grund av regleringsskäl, förändringar i skatte- eller bokföringslagar eller andra omständigheter. I sådana fall finns det risk för att delfondens exponering mot indexet kan avbrytas eller upphöra.

Delfondens investeringsmål kanske inte uppnås och delfonden kanske inte kan återvinna förluster som uppkommit, då det förstås att det sker en daglig återställning av swappen och att det finns en motpartsriskgräns på 10 %.

Brist på driftshistorik
En delfond kan ha bildats nyligen och ha en begränsad verksamhetshistorik som potentiella andelsägare kan utvärdera resultatet mot. Tidigare resultat för förvaltaren, investeringsförvaltaren eller eventuella underförvaltare kan inte tolkas som en indikation på framtida resultat för en investering i SICAV-fonden. Det finns ingen garanti för att en delfond kommer att uppnå sitt investeringsmål.

Hävstångsrisk
Delfondens nettoexponering över delfondens substansvärde gör dess andelskurs mer volatil.

I den utsträckning som delfonden använder derivat för att öka sin nettoexponering mot någon marknad, ränta, värdepapperskorg eller annan finansiell referenskälla ökar referenskällans kursvariationer

på delfondsnivå.

Likviditetsrisk på noteringsmarknad Börskursen för UCITS ETF-andelar kan avvika från det indikativa substansvärdet.

Likviditeten för delfondens andelar på en börs kan påverkas av tillfälliga stopp, i synnerhet men inte endast på grund av

i) tillfälligt eller totalt stopp i beräkningen av de underliggande värdepapperen och/eller indexet av indexleverantören
ii) tillfälligt stopp på marknaden eller marknaderna där de underliggande värdepapperen och/eller indexets underliggande värdepapper är noterade
iii) en relevant noteringsmarknads oförmåga att erhålla eller beräkna delfondens indikativa substansvärde
iv) en marknadsgarants överträdelse av reglerna som gäller på den relevanta noteringsmarknaden
v) fel i system, i synnerhet IT-system eller elektroniska system, på en relevant noteringsmarknad
vi) varje annan händelse som förhindrar beräkning av delfondens indikativa substansvärde eller handel med fondens andelar.

Förvaltningsrisk
Delfonden omfattas av förvaltningsrisk, vilket är risken för att investeringsprocess, tekniker och analyser som tillämpas av investeringsförvaltaren och aktuell underförvaltare (i förekommande fall) inte ger önskade resultat. Investeringsförvaltaren och/eller underförvaltaren (i förekommande fall) kan ha fel i sina analyser, antaganden eller prognoser och det finns ingen garanti för att de kommer att nå önskade resultat.

Marknadsrisk
Kurserna på många värdepapper förändras kontinuerligt och kan falla baserat på en mängd olika faktorer.
Exempel på dessa faktorer är:
– politiska och ekonomiska nyheter
– politiska åtgärder
– tekniska förändringar eller ny affärspraxis
– demografiska, kulturella och befolkningsrelaterade förändringar
– naturkatastrofer eller mänskligt orsakade katastrofer
– väder- och klimatförändringar
– vetenskapliga eller andra upptäckter
– priser och tillgång till energi, råvaror och naturtillgångar.
Effekterna av en viss marknadsrisk kan komma plötsligt eller ske stegvis, på kort eller lång sikt och de kan påverka i liten eller stor utsträckning.

Risker med MBS/ABS/TBA
Bostadsobligationer (MBS) och tillgångssäkrade krediter (ABS) är vanligtvis förenade med risk för förlängd löptid eller förtida återbetalning samt likviditets-, kredit- och ränterisk över genomsnittet.

Bostadsobligationer (som omfattar säkrade bostadsobligationer eller CMO) och tillgångssäkrade krediter (ABS) motsvarar en andel i en pool av obligationer, såsom kreditkortsfordringar, billån, studielån, leasing av utrustning, bostadslån och bostadsinteckningslån.

När räntorna sjunker betalas dessa värdepapper ofta av tidigt, då bolåneinnehavarna och andra låntagare återfinansierar den skuld som ligger till grund för säkerheten. När räntorna stiger tenderar låntagarna av den underliggande skulden att inte refinansiera sin skuld med låg ränta.

Bostadsobligationer och tillgångssäkrade krediter har också generellt lägre kreditkvalitet än många andra typer av räntepapper. I den mån betalningen för de skulder som är underliggande till en bostadsobligation eller en tillgångssäkrad kredit ställs in, eller inte kan drivas in, kommer de värdepapper som är baserade på dessa skulder att förlora en del av eller hela sitt värde.

Med värdepapper som kommer att tillkännages (”TBA”), och då delfonden inte känner till förrän 48 timmar efter det att den lägger en inköpsorder om faktiska MBS eller ABS kommer användas för att uppfylla ordern, kan delfonden inte vidta åtgärder för att motverka någon minskning av värdet av ett visst värdepapper under 48-timmarsperioden.

Risk med förbetalning och förlängning
Oväntade ränterörelser kan ha negativ inverkan på inlösenbara räntepapper (värdepapper vars emittenter har rätt att lösa in obligationen och betala ut kapitalbeloppet före förfallodatumet).

Om räntorna faller finns en risk att dessa emittenter löser in obligationerna och emitterar nya till en lägre ränta. I detta fall kan delfondens enda möjlighet vara att återinvestera pengarna till en lägre ränta (”**risk avseende förtida återbetalning**”).

Om räntorna däremot stiger brukar emittenterna inte vilja återbetala kapitalbeloppen i förtid. Detta kan leda till att delfonden hamnar i en situation med marknadsmässigt låg avkastning fram till dess att räntorna sjunker eller värdepapperen förfaller (”risk med förlängd löptid”). Dessutom kan det innebära att delfonden måste sälja värdepappren med förlust eller att den går miste om andra mer lönsamma investeringsmöjligheter.

Priset och räntan på inlösenbara räntepapper speglar vanligtvis ett antagande om att de kommer att återbetalas före förfallodatumet. Om så sker när det förväntas, brukar inte delfonden påverkas negativt. Men om det inträffar betydligt tidigare eller senare än väntat, kan det innebära att delfonden faktiskt har betalat ett allt för högt pris för dessa värdepapper. Andra faktorer kan också påverka när eller om ett enskilt värdepapper är förbetalt, inklusive om det förekommer eller inte förekommer valfria inlösenfunktioner och obligatoriska förskottsbetalningsfunktioner, fallissemangsfrekvensen för de underliggande tillgångarna och hur omsättningen ser ut i de underliggande tillgångarna.

Förskottsbetalnings- och förlängningsfaktorer kan också påverka delfondens duration eller öka eller minska dess räntekänslighet på ett ofördelaktigt sätt. Om räntorna inte stiger eller faller som förväntat kan det också uppstå risker förenade med förtida återbetalning eller förlängd löptid.

Risk med fastighetsinvesteringar:
Fastighetsinvesteringar, eller andra liknande placeringar, kan påverkas negativt av faktorer som gör att ett visst område eller en viss fastighet blir mindre värd.

Investeringar i fastighetsinnehav eller därtill relaterade verksamheter eller värdepapper (inklusive investeringar i bolån) kan till exempel påverkas negativt av naturkatastrofer, ekonomisk nedgång, överbyggnation, förändringar i stadsplanering, skattehöjningar, demografiska förändringar och livsstilstrender, miljöproblem, betalningsinställelser på bostadslån, förvaltarrelaterade misstag och andra faktorer som kan påverka investeringens marknadsvärde eller kassaflöde.

Indexreplikering med stickprov Indexreplikering genom att investera i en portfölj som omfattar alla indexkomponenter kan vara kostsamt eller inte alltid möjligt eller praktiskt genomförbart. Under vissa omständigheter kan delfondens investeringsförvaltare använda en optimerad replikeringsmetod, i synnerhet en strategi med stickprovsteknik för indexreplikering. I detta syfte kommer delfondens investeringsförvaltare att försöka replikera indexet antingen genom att:

i. investera genom ett urval av representativa överlåtbara värdepapper som utgör jämförelseindexet men potentiellt med olika viktning jämfört med indexkomponenterna, och/eller
ii. genom att investera i en portfölj med överlåtbara värdepapper som inte kan omfattas av detta index eller andra godtagbara tillgångar som finansiella derivatinstrument.

Även om delfonden strävar efter att följa indexets resultat med en strategi med stickprovsteknik för indexreplikering, finns det ingen garanti för att den kan följa det perfekt och delfonden kan potentiellt bli föremål för en högre aktiv risk, som är risken att delfondens avkastning från tid till annan inte följer indexets avkastning exakt. Dessutom kan användningen av representativa stickprov leda till att delfondens övergripande ESG-egenskaper eller ESG-risker avviker från referensindexets.

Aktier i små och medelstora företag:
Aktier i små och medelstora företag kan vara mer volatila än aktier i större företag.
Små och medelstora företag har ofta mer begränsade finansiella resurser, kortare verksamhetshistorik och mindre diversifierade verksamheter. På så vis kan de vara mer sårbara för konkurs eller

långsiktiga eller bestående nedgångar. Börsintroduktioner kan vara förenade med betydande kurssvängningar och vara svåra att bedöma på grund av bristen på handelshistorik och annan offentlig information.

Risk med investeringsstil:
Olika investeringsstilar blir vanligen mer eller mindre populära beroende på marknadsförhållanden och stämningen bland investerarna.
Till exempel kan en portfölj med tillväxtinriktning när som helst prestera sämre än en portfölj med värdeinriktning, eller tvärtom, och båda kan när som helst prestera sämre än marknaden som helhet.
Värdepapper som identifieras som undervärderade kan förbli undervärderade på obestämd tid eller visa sig ha varit korrekt värderade. För värdepapper som bedöms ha högre tillväxtpotential än genomsnittet kan en betydande andel av marknadskursen vara baserad på höga förväntningar på framtida resultat. Om det börjar visa sig att dessa höga förväntningar kanske inte nås kan kursen sjunka snabbt och kraftigt.

Risk med hållbara investeringar:
Förvaltningsbolaget beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer både vid val av det jämförelseindex vars resultat replikeras och när investeringsbeslut fattas för delfonderna.

Så som det anges i berörd delfonds beskrivning upprättas vissa delfonder med antingen i) en placeringsinriktning som strävar efter att främja miljömässiga och sociala egenskaper eller ii) ett mål om att minska koldioxidutsläppen. För dessa delfonder exkluderar den relevanta investeringsförvaltaren värdepapper i enlighet med förvaltningsbolagets uteslutningslista enligt beskrivningen i den ovan beskrivna policyn för ansvarsfulla investeringar.

Vissa delfonder och eventuella replikerade index kan ha ett investeringsområde som fokuserar på företag som uppfyller specifika kriterier, inklusive ESG-betyg, och hänför sig till vissa teman för hållbar utveckling och visar att de följer praxis för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning. Följaktligen kan investeringsområdet för sådana delfonder och eventuella replikerade index vara mindre än för andra delfonder och index.

För delfonder som följer eller använder ett jämförelseindex bör investerare notera att jämförelseindexet endast förlitar sig på analys från jämförelseindexets administratör eller andra dataleverantörer (i förekommande fall) beträffande hållbarhetsöverväganden. Varken SICAV, eller någon av dess tjänsteleverantörer, förvaltningsbolaget eller investeringsförvaltarna gör inga utfästelser eller garantier avseende korrektheten, tillförlitligheten och fullständigheten för hållbarhetsrelaterade data eller hur dessa implementeras.

ESG-information från tredjepartsleverantörer kan vara ofullständig, felaktig eller otillgänglig. Som ett resultat finns det en risk att administratören av jämförelseindexet om tillämpligt eller andra dataleverantörer (i förekommande fall) kan göra en felaktig bedömning av ett värdepapper eller en emittent, vilket kan leda till felaktig inkludering eller uteslutning av ett värdepapper i en delfonds portfölj eller i förekommande fall i jämförelseindexet och därför delfondens portfölj.

Det bör också noteras att analysen av företagens ESG-resultat kan baseras på modeller, uppskattningar och antaganden. Denna analys bör inte ses som en indikation på eller garanti för nuvarande eller framtida resultat.

Sådana delfonder och eventuella replikerade index kan (i) utvecklas sämre än marknaden som helhet om sådana investeringar går sämre än marknaden och/eller (ii) utvecklas sämre än andra fonder, jämförelseindexet eller moderindexet eller indexets godtagbara investeringsområde (om relevant) som inte använder ESG-kriterier och/eller skulle kunna få delfonden att sälja investeringar på grund av ESG-relaterade problem, som både har en bra utveckling och därefter utvecklas väl.

Uteslutning eller avyttring av värdepapper från emittenter som inte uppfyller vissa ESG-kriterier från indexmetoden om tillämpligt eller delfondens investeringsområde kan få delfonden och om tillämpligt indexet att utvecklas annorlunda än liknande index och fonder som inte har en policy för ansvarsfulla investeringar eller en ESG-komponent i sin investeringsstrategi och/eller eventuellt i sin indexmetod och som inte tillämpar kriterier för ESG-granskning vid urval av investeringar.

Delfonder fullmaktsröstar på ett sätt som är förenligt med aktuella ESG-uteslutningskriterier, vilket kanske inte alltid är förenligt med att maximera den berörda emittentens kortsiktiga resultat. Närmare information om Amundis röstningspolicy för ESG finns i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar på www.amundi.com.

Urvalet av tillgångar kan bygga på en egenutvecklad ESG-betygsprocess (t.ex. indexleverantörers) som delvis eller helt bygger på data från tredje part. Data som tillhandahålls av tredje part kan vara ofullständiga, felaktiga eller otillgängliga och det finns därför en risk för att investeringsförvaltaren gör en felaktig bedömning av ett värdepapper eller en emittent.

Hållbarhetsrisk:
En miljörelaterad, social eller styrningsrelaterad händelse eller omständighet som, om den skulle inträffa, skulle ha en faktisk eller potentiell betydande negativ inverkan på investeringens värde.

Risker relaterade till miljöfrågor inkluderar, men är inte begränsade till, klimatrisker, både fysiska risker och omställningsrisker. Fysisk risk uppstår från de fysiska effekterna av klimatförändringar, akuta eller kroniska. Exempelvis kan ofta förekommande och svåra klimatrelaterade händelser ha en negativ inverkan på produkter, tjänster och leverantörskedjor. Omställningsrisk kan uppstå oavsett om policy, teknik, marknad eller rykte förändras genom omställning till en ekonomi med låga koldioxidutsläpp för att mildra klimatförändringarna.

Risker relaterade till sociala frågor kan omfatta men är inte begränsade till mänskliga rättigheter, hälsa och säkerhet, ojämlikhet, integration och arbetsrättigheter.

Risker relaterade till bolagsstyrning kan omfatta men är inte begränsade till risker kring betydande och återkommande överträdelser av internationella avtal, korruption, styrelsens oberoende, ägarstruktur och kontroll, eller revision och skattehantering.

Dessa risker kan påverka en emittents operativa effektivitet och motståndskraft samt hur den allmänt uppfattas och dess anseende, vilket påverkar dess lönsamhet och i sin tur dess kapitaltillväxt och i slutändan påverkar värdet på delfondens investeringar eller i förekommande fall komponenterna i det index som följs av delfonden.

Risk gällande hållbarhetsdata
Investeringsförvaltaren eller indexleverantören, enligt vad som är tillämpligt, utvärderar värdepapper för inkludering och/eller viktning i delfondens portfölj eller jämförelseindexet baserat på ESG-kriterier och data som tillhandahålls av indexleverantören eller tredje part.

Utvärderingen av värdepapperens ESG-egenskaper beror på dessa kriterier och data, som kan variera beroende på indexleverantör/dataleverantör, och förvaltningsbolaget eller SICAV-fonden kan inte garantera att de kommer att vara kompletta, korrekta eller aktuella.

Förvaltningsbolaget och SICAV-fonden gör inga utfästelser om giltigheten och korrektheten för dataleverantörens eller indexleverantörens utvärdering av värdepapperens ESG-egenskaper eller de kriterier och data som används i en sådan utvärdering. Fel avseende uppgifternas kvalitet, korrekthet och fullständighet kan förekomma från tid till annan och kanske inte identifieras och åtgärdas under en tidsperiod, särskilt i de fall indexen eller uppgifterna används mindre ofta. Konsekvenserna av hållbarhetsrisker kommer sannolikt att utvecklas över tid och nya hållbarhetsrisker kan identifieras i takt med att ytterligare data och information blir tillgängliga.

Även om indexleverantörer av jämförelseindex för delfonder som följer index tillhandahåller beskrivningar av vad varje jämförelseindex är utformat för att uppnå, ger indexleverantörer i allmänhet inte någon garanti eller tar något ansvar för uppgifternas kvalitet,

korrekthet eller fullständighet med avseende på sina jämförelseindex eller i sina dokument om indexmetoden eller någon garanti för att de publicerade indexen kommer att överensstämma med de beskrivna metoderna för jämförelseindex.

Risk för divergens med investerarnas kriterier för ESG-minimistandarder:
Investerare kan skilja sig åt i sina tolkningar av vad som utgör positiva eller negativa ESG-egenskaper hos ett företag, ett instrument eller en delfond. Varken SICAV-fonden eller ett instrument eller en portfölj gör några utfästelser eller liknande vad gäller lämpligheten för det eventuella jämförelseindexet och delfonden när det gäller att uppfylla en investerares kriterier för minsta ESG-standarder eller liknande. Investerare rekommenderas att göra en egen granskning av om det eventuella jämförelseindexet och/eller delfonden följer de egna ESG-kriterierna.

Risk relaterad till ESG-kategoriseringar eller landsmärkning:
Vissa delfonder har antagit eller erhållit ESG-kategoriseringar (till exempel enligt SFDR eller de franska AMF-reglerna) eller landsmärkningar (till exempel belgiska Febelfin eller franska SRI).

Om sådana delfonder replikerar ett jämförelseindex och de upphör att uppfylla kraven i sina ESG-kategoriseringar eller märkningar är de tänkta att återgå till sina respektive jämförelseindex vid eller i samband med nästa indexombalansering.

Vid en sådan tidpunkt kommer delfondernas portfölj att justeras och/eller ombalanseras i linje med sina respektive jämförelseindex, med förbehåll för eventuella begränsningar som gäller för delfonderna till följd av deras ESG-kategoriseringar eller landsmärkningar men som inte tillämpas av indexleverantören på deras jämförelseindex (oavsett om sådana begränsningar inte ingår i indexmetoden eller av misstag).

Om en delfond inte får inneha ett värdepapper från jämförelseindexet för att följa en begränsning i dess ESG-kategorisering eller landsmärkning som inte uppfylls av jämförelseindexet, kan detta öka skillnaden mellan delfondens och indexets resultat samt delfondens aktiva risk (om tillämpligt). En sådan ökning skulle kunna förvärras av marknadens volatilitet. Det kan uppstå omständigheter från tid till annan där en indexleverantör finner att det inte är möjligt att ombalansera ett jämförelseindex för att på optimal basis uppfylla alla ESG- och icke-ESG-mål i jämförelseindexet samtidigt och indexleverantören kan välja att släppa på vissa ESG- eller icke-ESG-mål baserat på dess regler för att genomföra ombalanseringen. Om detta inträffar påverkar det i sin tur delfondens resultat när ett sådant jämförelseindex används eller följs vid en ombalansering.

Regler och standarder för ESG-kategoriseringar och märkning utvecklas ständigt. I takt med att sådana regler utvecklas över tid kan de bli striktare och kan avvika från indexmetoder och investeringsmål, policyer eller strategier för delfonderna och kan till och med hamna i konflikt med varandra. Det kanske inte är möjligt eller praktiskt genomförbart för en delfond att fortsätta följa de ändrade reglerna samtidigt som dess befintliga investeringsmål, policy och strategi bibehålls, eller så kanske det inte ligger i delfondens och dess andelsägares intresse som helhet att göra det. I sådana situationer kan delfonden upphöra att upprätthålla vissa ESG-kategoriseringar eller märkningar efter utgången av den period som anges för att förbli kompatibel med tillämpliga regler för ESG-kategoriseringar eller märkningar.

Risk relaterad till indexgranskningar eller ombalansering:
Indexleverantören kan utvärdera ESG-data på säkerhetsnivå (inklusive betyg) och, om tillämpligt, ESG-mål eller begränsningar som är relevanta för referensindexet endast vid indexgranskningar eller ombalansering. Värdepapper som ingår i referensindexet kan upphöra att uppfylla relevanta ESG-kriterier, men kan ändå vara kvar i referensindexet och delfonden till nästa granskning eller ombalansering av indexleverantören. Det innebär att vissa värdepapper i referensindexet eller referensindexet som helhet inte alltid uppfyller relevanta ESG-mål eller begränsningar. Om ESG-bedömningen av en säkerhet i referensindexet eller delfonden ändras, åtar sig varken delfonden eller förvaltningsbolaget något ansvar i samband med en sådan förändring.

Förvaltningsbolaget övervakar inte värdepapper i referensindexet med avseende på ESG-mål eller ESG-begränsningar som tillämpas av indexleverantören och är inte ansvarigt för ändringar i ESG-bedömningen av en säkerhet i referensindexet mellan ombalanseringar.

Risker kopplade till ESG-metoder:
Jämförelseindex med en komponent för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (”**ESG**”) använder vanligtvis en ”bäst i klassen”-metod eller en metod för förbättring av ESG-betyg. Båda metoderna är relaterade till en investeringsinriktning.

Det kan dock hända att företag med låga ESG-betyg kan ingå i indexsammansättningen om tillämpligt och att indexets övergripande ESG-betyg skulle vara lägre än det övergripande ESG-betyget för ett index utan ESG-kriterier baserat på ett annat investeringsområde.

På grund av att ESG-kriterierna tillämpas på det aktuella moderindexet eller investeringsområdet för att fastställa godtagbarhet för att ingå i det aktuella jämförelseindexet eller i delfondens portfölj kommer jämförelseindexet eller delfondens portfölj att bestå av ett smalare investeringsområde av värdepapper jämfört med moderindexet eller investeringsområdet och värdepapperen i jämförelseindexet eller i delfondens portfölj kommer sannolikt också att ha olika sektorviktningar och faktorviktningar enligt Global Industry Classification Standard (GICS®) jämfört med moderindexet eller investeringsområdet.

Effekterna av risker relaterade till ESG-investeringar kommer sannolikt att förändras över tid, och nya hållbarhetsrisker och -faktorer kan identifieras i takt med att ytterligare data och information om ESG-faktorer och -effekter blir tillgängliga. Dessutom fortsätter metoderna för ESG-investeringar att utvecklas, och ESG-metoden som tillämpas av administratören för referensindexet kan ändras med tiden.

Investerare bör notera att fastställandet av att en delfond omfattas av informationskraven för en finansiell produkt enligt artikel 8 i SFDR görs enbart på grundval av att referensindexet främjar miljörelaterade och sociala egenskaper. SICAV förlitar sig enbart på den verksamhet som bedrivs av och information som tillhandahålls av administratören för referensindexet eller andra dataleverantörer (om tillämpligt) för att fastställa detta.

Risk relaterad till beräkning av ESG-betyg:
Det bör noteras att de flesta ESG-betyg inte definieras i absoluta termer, utan i relativa termer, där ett företag jämförs med en likvärdig grupp.
Som ett resultat av detta kan företag som marknaden generellt uppfattar har mediokra ESG-metoder potentiellt få ett bra betyg om de andra företagen i dess grupp har lägre standard än deras ESG-metoder. Företagens ESG-betyg beräknas av ett ESG-kreditvärderingsinstitut baserat på rådata, modeller och uppskattningar som samlas in/beräknas enligt metoder som är specifika för varje aktör. De flesta av dem använder en mängd olika informationsvektorer och kanaler: Frågeformulär som skickas till företag, användning av information som offentliggörs av de enheter som berörs av uppgifterna eller av betrodda tredje parter (presstjänster, icke-statliga myndigheter), användning av data som produceras av andra leverantörer till sektorn genom prenumerationer eller partnerskap.

Den insamlade informationen kan kompletteras, specificeras eller korrigeras genom diskussioner med de företag som uppgifterna gäller.

Kreditvärderingsinstituten publicerar vägledning om sina metoder och kan lämna ytterligare information på begäran. Det saknas dock standardisering, och eftersom metoderna är egenutvecklade kan den information som lämnas vara ofullständig, i synnerhet när det gäller den exakta beskrivningen av de variabler som används vid beräkningen av betygen, hanteringen av dataloggar och viktningen av de olika variablerna och komponenterna i betygen samt beräkningsmetoderna.

Det kan också uppstå en tidsfördröjning mellan det datum då informationen samlas in och det datum då uppgifterna används, vilket kan påverka informationens aktualitet och kvalitet.

Varken delfonden, SICAV, förvaltaren eller investeringsförvaltaren gör några utfästelser eller garantier, varken uttryckliga eller

underförstådda, med avseende på huruvida informationen från jämförelseindexets leverantör/dataleverantörer, ESG-betyg, screeningkriterier eller hur de implementeras är korrekta, riktiga, rimliga eller fullständiga. Om status för ett värdepapper som tidigare ansågs kunna ingå i jämförelseindexet eller investeringsområdet ändras, tar varken delfonden, SICAV-fonden, förvaltaren eller investeringsförvaltaren ansvar för en sådan ändring.

Användning av tekniker och instrument

Risk med återköpsavtal och omvända återköpsavtal
Delfondens ingående av återköpsavtal och omvända återköpsavtal innebär vissa risker och det finns ingen garanti för att det mål som eftersträvas av denna användning kommer att uppnås.

Investerare måste framför allt vara medvetna om att:
(1) om den motpart hos vilken en delfonds likvida medel har placerats skulle hamna på obestånd, finns det en risk att värdet på den mottagna säkerheten blir lägre än de utplacerade likvida medlen, antingen på grund av felaktig prissättning av säkerheten, negativ marknadsutveckling, en försämring av kreditbetyget för de värdepapper som ingår i säkerheten eller bristande likviditet på den marknad där säkerheten handlas; att
(2) (i) likvida medel binds upp i transaktioner av alltför stor omfattning eller duration, (ii) förseningar i återvinningen av utplacerade likvida medel eller (iii) svårigheter att realisera säkerheter, kan begränsa delfondens förmåga att fullgöra sina betalningsförpliktelser i samband med försäljningsbegäranden, köp av värdepapper eller, mer generellt, återinvesteringar.

Återinvestering av den kontanta säkerhet som erhålls i samband med återköpstransaktioner innebär risker förknippade med den typ av investeringar som gjorts och risken för att värdet på den återinvesterade kontanta säkerheten vid återlämnandet kan sjunka under det belopp som motparterna är skyldiga. Det kan skapa en hävstångseffekt som beaktas vid beräkningen av fondens globala exponering.

Användningen av återköpstransaktioner medför även rättsliga risker. På grund av en transaktions natur eller en parts rättsliga förmåga att ingå den, kan det finansiella avtalet bli ogenomförbart och en motparts insolvens eller konkurs kan påverka i övrigt verkställbara avtalsrättigheter.

Användningen av återköpstransaktioner medför även operativa risker, dvs. risk för förluster på grund av fel, tjänsteavbrott eller andra haverier samt bedrägeri, korruption, elektronisk brottslighet, instabilitet, terrorism eller andra onormala händelser i avvecklings- och redovisningsprocessen.

En delfond som ingår återköpstransaktioner kan även utsättas för förvaringsrisk, dvs. risken för förlust på tillgångar som förvaras i händelse av ett förvaringsinstituts (eller underförvaringsinstituts) insolvens, försumlighet, bedrägeri, bristande förvaltning eller otillräcklig bokföring.

Risk med värdepappersutlåning
Lånade värdepapper kanske inte återlämnas i tid, eller alls, i händelse av låntagarens betalningsinställelse, konkurs eller insolvens och rättigheter till säkerheten kan gå förlorade om låneombudet hamnar på obestånd. Om låntagaren av värdepapper utlånade av en delfond inte återlämnar dessa värdepapper finns det en risk att den erhållna säkerheten kan realisera mindre än värdet på de värdepapper som lånats ut, oavsett om det beror på felaktig kurssättning, negativa marknadsrörelser, en försämrad kreditvärdering av säkerhetens emittenter eller på illikviditet på den marknad där säkerheten omsätts.

En delfond kan återinvestera den kontantsäkerhet som erhålls från låntagare. Återinvestering av den kontanta säkerhet som erhållits i samband med transaktioner med värdepappersutlåning innebär risker förknippade med den typ av investeringar som gjorts och risken för att värdet på den återinvesterade kontanta säkerheten vid återlämnandet kan ha sjunkit under det belopp som motparterna är skyldiga. Det kan skapa en hävstångseffekt som beaktas vid beräkningen av fondens globala exponering. Förseningar i återlämnande av utlånade värdepapper kan begränsa möjligheten för delfonden att uppfylla leveransskyldigheter enligt värdepappersförsäljning eller betalningsförpliktelser som härrör från inlösenbegäran. Värdepapperslån medför också operativa risker såsom att instruktioner om avräkning inte sker. Sådana operativa risker hanteras genom förfaranden, kontroller och system som genomförs av ombudet för värdepappersutlåning och förvaltningsbolaget. Användningen av transaktioner med värdepappersutlåning medför också rättsliga risker.

På grund av en transaktions natur eller en parts rättsliga förmåga att ingå den, kan det finansiella avtalet bli ogenomförbart och en motparts insolvens eller konkurs kan påverka i övrigt verkställbara avtalsrättigheter.

Användningen av transaktioner för värdepappersutlåning medför också operativa risker, dvs. risk för förluster på grund av fel, tjänsteavbrott eller andra haverier, samt bedrägeri, korruption, elektronisk brottslighet, instabilitet, terrorism eller andra oregelbundna händelser i avräknings- och bokföringsprocessen. En delfond som ingår transaktioner för värdepappersutlåning kan även utsättas för förvaringsrisk, dvs. risken för förlust på tillgångar som förvaras i händelse av ett förvaringsinstituts (eller underförvaringsinstituts) insolvens, försumlighet, bedrägeri, bristande förvaltning eller otillräcklig bokföring. Dessutom kan en delfond som bedriver värdepappersutlåning erhålla säkerheter som kanske inte uppfyller de hållbarhetskrav och/eller ESG-kriterier som tillämpas av indexleverantören i förekommande fall.

Volatilitetsrisk
Ändringar i volatilitetsmönster på relevanta marknader kan skapa plötsliga och/eller väsentliga förändringar i delfondens andelskurs.

RISKER VID OVANLIGA MARKNADSFÖRHÅLLANDEN

De risker som ingår i detta avsnitt förekommer i allmänhet inte i någon väsentlig grad under normala marknadsförhållanden (även om de kan förekomma i begränsad omfattning). Under ovanliga marknadsförhållanden kan dessa risker dock vara bland de allvarligaste.

Motpartsrisk:
En enhet med vilken delfonden gör affärer (t.ex. genom att ingå OTC-derivatavtal eller effektiva metoder för portföljförvaltning som återköp eller transaktioner med värdepappersutlåning) kan bli ovillig eller oförmögen att fullgöra sina skyldigheter gentemot delfonden.

Fallissemangsrisk:
Emittenter av vissa obligationer kan bli oförmögna att göra betalningar för sina obligationer.

Likviditetsrisk:
Ett värdepapper kan bli svårt att värdera eller sälja vid önskad tidpunkt och till önskad kurs.

Likviditetsrisken kan påverka delfondens förmåga att återbetala återköpslikviden inom den tidsfrist som anges i prospektet.

Juridisk risk:
Användningen av tekniker för effektiv portföljförvaltning och finansiella derivatinstrument medför rättsliga risker. På grund av en transaktions natur eller en parts rättsliga förmåga att ingå den, kan det finansiella avtalet bli ogenomförbart och en motparts insolvens eller konkurs kan påverka i övrigt verkställbara avtalsrättigheter.

Operativ risk:
I vilket land som helst, men särskilt på tillväxtmarknader, kan det uppstå förluster när tillgångarna inte segregerats, tjänsteavbrott eller andra fel samt bedrägeri, korruption, elektronisk brottslighet, instabilitet, terrorism eller andra ovanliga händelser. Operativa risker kan påverka delfondens kapacitet, bland annat när det gäller värdering, prissättning, redovisning, skatterapportering, finansiell rapportering och handel. Det är inte säkert att operativa risker upptäcks på en gång, och även om så sker kan det visa sig vara olämpligt att omedelbart utkräva ersättning från de som är ansvariga.

Risker med etablerad praxis Investeringsmetoder som tidigare fungerat bra och anses vara godtagbar praxis när det gäller att hantera vissa situationer kan bli verkningslösa.

ALLMÄN PLACERINGSINRIKTNING

SICAV-fonden och alla dess delfonder ska följa alla tillämpliga lagar och förordningar i EU och Luxemburg liksom vissa cirkulärbrev, tekniska standarder och andra krav. I det här avsnittet beskrivs, i kortfattad form, kraven på portföljförvaltning i lagen av 2010, den centrala lagen för driften av ett fondföretag samt kraven från ESMA gällande riskövervakning och -hantering. Vid eventuella avvikelser ska lagen i sig (som är på franska) ha företräde.

I händelse av att en överträdelse av lagen av 2010 upptäcks, måste den eller de berörda delfonderna följa relevanta policyer som en prioritet i sin värdepappershandel och sina förvaltningsbeslut, med vederbörlig hänsyn till andelsägarnas intressen. Om inte annat anges gäller alla procentsatser och begränsningar för varje delfond enskilt.

FÖR ALLA DELFONDER UTOM PENNINGMARKNADSDELFONDER

TILLÅTNA VÄRDEPAPPER OCH TRANSAKTIONER

Tabellen nedan beskriver de typer av värdepapper och transaktioner som är tillåtna för fondföretag enligt lagen av 2010. Närmare villkor och begränsningar ska fastställas för varje enskild delfond baserat på dess specifika mål och placeringsinriktning. Ingen delfond kommer att använda de investeringar som beskrivs på rad 6 och 9, utöver vad som beskrivs i ”Beskrivning av delfonder”. Med andra ord ska användningen av tillgångar, investeringstekniker och transaktioner vara förenlig med varje enskild delfonds specifika mål och placeringsinriktning. En delfond som investerar eller marknadsförs i jurisdiktioner utanför EU kan omfattas av ytterligare krav (som inte beskrivs här) från tillsynsmyndigheter i dessa jurisdiktioner.
En delfond behöver inte följa investeringsgränserna vid utövandet av teckningsrätter, så länge som eventuella överträdelser korrigeras enligt ovan. Ingen delfond kan förvärva tillgångar som medför obegränsat ansvar, och ingen delfond kan förbinda sig att överta värdepapper utfärdade av andra emittenter.

Med undantag för situationer med exceptionellt ogynnsamma marknadsförhållanden där en tillfällig överträdelse av gränsen på 20 % krävs av omständigheterna och motiveras med hänsyn till aktieägarnas intressen, får bolagets delfonder hålla upp till 20 % av sina nettotillgångar i bankinsättningar på avistakonton som är tillgängliga när som helst, för att täcka löpande eller exceptionella betalningar, eller under den tid som krävs för att återinvestera i godtagbara tillgångar eller under en tidsperiod som är absolut nödvändig vid ogynnsamma marknadsförhållanden.

Värdepapper/transaktion	Krav	
1. Överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument	Måste vara noterade eller handlas på en officiell börs i en godkänd stat eller på en reglerad marknad i en godkänd stat med regelbunden handel som är öppen för allmänheten.	Nyligen emitterade värdepapper måste ansöka om notering på en börs eller reglerad marknad i en godkänd stat och måste bli noterade inom 12 månader efter emissionen.
2. Penningmarknadsinstrument som inte uppfyller kraven på rad[35]	Måste omfattas (antingen på värdepappersnivå eller på emittentnivå) av investerarskydd och bestämmelser för sparande och måste också uppfylla något av följande kriterier: ● emitterade eller garanterade av en central, regional eller lokal myndighet eller centralbank i en EU-medlemsstat, av Europeiska centralbanken, Europeiska investeringsbanken, EU, ett offentligt internationellt organ i vilket minst en EU-medlemsstat är medlem, en suverän stat eller en medlemsstat i en federal statsbildning ● emitterade av en emittent eller ett företag vars värdepapper är kvalificerade enligt rad 1 ovan ● emitterade eller garanterade av en emittent som omfattas av EU:s tillsynsregler eller andra tillsynsregler som beaktas av CSSF som likvärdiga.	Kan även vara kvalificerade om emittenten tillhör en kategori som är godkänd av CSSF, omfattas av investerarskydd som motsvarar dem som beskrivs till vänster och uppfyller ett av följande kriterier: ● emitterade av ett företag med kapital och reserver på minst 10 miljoner euro som offentliggör sin årsredovisning ● utfärdade av en emittent som finansierar en grupp med företag, varav minst ett av dem är börsnoterat ● utfärdade av en emittent som finansierar värdepapperiseringar som drar nytta av en bankkredit.
3. Andelar i UCITS- eller andra UCI-fonder som saknar koppling till SICAV-fonden	Måste ha tillstånd av en EU-medlemsstat eller en stat som CSSF bedömer har motsvarande lagar om tillsyn och tillräckligt samarbete mellan myndigheter. Måste utfärda års- och halvårsrapporter. Måste enligt fondbestämmelserna och stadgarna vara begränsade till att investera högst 10 % av tillgångarna i andra UCITS- eller UCI-fonder.	Måste antingen omfattas av EU:s tillsyn och investerarskydd för en UCITS-fond eller motsvarande utanför EU (särskilt när det gäller segregering av tillgångar, upplåning, utlåning och blankning av överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument).

[35] Ett fondföretag/företag för kollektiva investeringar (UCITS-/UCI-fond) anses vara kopplat till SICAV-fonden om båda förvaltas eller kontrolleras av samma eller närstående förvaltningsbolag, eller om SICAV-fonden direkt eller indirekt innehar mer än 10 % av UCITS-/UCI-fondens kapital- eller rösträttigheter

4. Andelar i UCITS- eller andra UCI-fonder som har koppling till SICAV-fonden	Måste uppfylla alla krav i rad 3. UCITS/UCI-fonder kan inte införa några avgifter för köp, byte eller inlösen av andelar.	I prospektet för varje delfond med betydande investeringar i andra UCITS- eller UCI-fonder, måste högsta förvaltningsavgift anges för själva delfonden och för UCITS- eller UCI-fonder som den avser att ha innehav i.
5. Andelar i andra delfonder i SICAV-fonden	Måste uppfylla alla krav i raderna 3 och 4. Däremot kan måldelfonden inte investera i den förvärvande delfonden (ömsesidigt ägande). Vid tidpunkten för investeringen får delfonden inte ha mer än 10 % av sina tillgångar i någon annan delfond.	Den förvärvande delfonden avstår från alla rösträtter i andelar som den förvärvar. Andelarna räknas inte som tillgångar för delfonden för lägsta tröskelvärden för tillgångar. Enligt dessa krav undantas SICAV-fonden från kraven i lagen av den 10 augusti 1915.
6. Fastigheter och råvaror, inklusive ädelmetaller	Investeringsexponering är endast tillåten via överlåtbara värdepapper, derivat eller andra tillåtna typer av investeringar.	SICAV-fonden kan direkt förvärva fastigheter eller annan materiell egendom som är direkt nödvändig för verksamheten. Äganderätten till ädelmetaller eller råvaror, direkt eller via certifikat, är förbjuden.
7. Insättningar hos kreditinstitut	Måste kunna tas ut på begäran och får inte ha en löptid som är längre än 12 månader.	Institutionerna måste antingen ha sitt huvudkontor i en EU-medlemsstat eller, om inte, omfattas av EU:s tillsynsregler eller andra tillsynsregler som beaktas av CSSF som likvärdiga.
8. Kompletterande likvida tillgångar	Bankinsättningar vid synhåll som är tillgängliga när som helst	–
9. Derivat och motsvarande kontantavräknade instrument	Underliggande investeringar eller referensindikatorer ska vara de som beskrivs på rad 1, 2, 3, 4, 6 och 7, eller index, räntor, valutakurser eller valutor. I samtliga fall måste dessa investeringar eller indikatorer och eventuella investeringar som de levererar omfattas av delfondens investeringar i andra tillgångar än derivat. Den totala exponeringen får inte överstiga 100 % av delfondens tillgångar.	Samtliga av följande kriterier måste vara uppfyllda i fråga om OTC-derivat: ● tillhöra kategorier som godkänts av CSSF ● ha tillförlitliga dagliga värderingar som är korrekta och oberoende ● kunna säljas, likvideras eller på annat sätt avslutas till verkligt värde när som helst ● vara med motparter som är föremål för tillsyn ● ha riskprofiler som kan mätas på ett adekvat sätt ● motpartsrisken får inte överstiga 10 % av delfondens tillgångar när motparten är ett kreditinstitut eller 5 % med andra motparter.
10. Överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som inte uppfyller kraven i raderna 1, 2, 6 och 7	Begränsat till 10 % av delfondens tillgångar.	–
11. Ut- och inlåning av värdepapper, återköpsavtal och omvända återköpsavtal	Transaktionsvolymen får inte hindra delfondens möjlighet att uppfylla sin placeringsinriktning eller tillgodose säljorder.	Kontanta säkerheter från transaktionerna måste investeras i högkvalitativa, kortfristiga investeringar. Det är förbjudet att låna ut eller garantera lån till tredje part i andra ändamål.
12. Tekniker och instrument för effektiv portföljförvaltning	Måste avse överlåtbara värdepapper eller penningmarknadsinstrument.	Denna kategori omfattar derivat. Se ”Mer om derivat och tekniker” nedan.
13. Lån	Med undantag för ”back-to-back-lån” som används för att förvärva utländska valutor, måste alla lån vara tillfälliga och begränsas till 10 % av delfondens nettotillgångar.	–

KRAV PÅ DIVERSIFIERING

För att säkerställa diversifiering får en delfond inte investera mer än ett visst belopp av sina tillgångar i en enskild enhet eller typ av värdepapper. I denna och i nästa tabell avses med en ”enhet” ett enskilt företag, med undantag för de gränser på 20 % i kolumnen ”Sammanlagt”, som övervakas på koncernnivå eller konsoliderad nivå. Dessa regler för diversifiering gäller inte under de första sex månaderna av en delfonds verksamhet.

MAXIMAL INVESTERING/EXPONERING, I PROCENT AV DELFONDENS TILLGÅNGAR

Värdepapperskategori	I en och samma emittent	Sammanlagt	Övrigt
A. Värdepapper och penningmarknadsinstrument som emitteras eller garanteras av en stat, en lokal myndighet inom EU eller ett internationellt organ där minst ett EU-land är medlem.	35 %		En delfond kan investera i så få som sex emissioner om den investerar enligt principen om riskspridning och uppfyller båda av följande kriterier: 1. emissionerna är överlåtbara värdepapper eller penningmarknadsinstrument som emitteras eller garanteras av en stat, en lokal myndighet inom EU eller ett internationellt organ där minst ett EU-land är medlem 2. delfonden investerar högst 30 % i en enda emission
B. Säkerställda obligationer* och obligationer som emitterats före den 8 juli 2022 omfattas av rättsligt fastställt investerarskydd** och som emitterats av ett kreditinstitut med hemvist i EU.	25 %		80 % i obligationer från alla emittenter eller enheter i vilka delfonden investerat mer än 5 % av tillgångarna.
C. Alla överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument utöver de som beskrivs i raderna A och B ovan.	10 %	35 %	20 % i alla företag inom en enda emittent. 40 %, sammanlagt, i alla emittenter eller enheter i vilka en delfond har investerat mer än 5 % av sina tillgångar.
D. Insättningar hos kreditinstitut.	20 %	20 %	
E. OTC-derivat med en motpart som är ett kreditinstitut enligt definitionen i rad 7 (föregående tabell).	10 % exponering		
F. OTC-derivat med annan motpart.	5 % exponering		
G. Andelar i UCITS- eller UCI-fonder, enligt definitionen i raderna 3 och 4 (föregående tabell).	20 %	10 % Om så anges i den berörda delfondsbeskrivningen kan denna gräns höjas till 30 % i UCI-fonder och 100 % i UCITS	UCI-delfonder vars tillgångar är åtskilda betraktas var och en som en separat UCI-fond. För överensstämmelse med raderna A–F i denna tabell räknas inte tillgångar som innehas av UCITS- eller andra UCI-fonder.

* Obligationer som omfattas av definitionen av säkerställda obligationer i artikel 3.1 i Europaparlamentets och rådets direktiv (EU) 2019/2162 av den 27 november 2019 om utgivning av säkerställda obligationer och offentlig tillsyn över säkerställda obligationer.
** Obligationer måste investera intäkterna från emissionen för att upprätthålla full ansvarstäckning och prioritera återbetalning till obligationsinvesterare i händelse av emittentens konkurs.

FONDER SOM FÖLJER INDEX

	Maximal indexviktning		
Komponenter	**I någon komponent**	**I en enda komponent endast**	**Övriga villkor och krav**
A. Överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument enligt definitionen på rad 1 och 2 i tabellen med tillåtna värdepapper och transaktioner B. Andelar i UCITS- eller UCI-fonder C. Derivat (OTC eller som handlas på en reglerad marknad) D. Andra än artikel 41(1) i lagen av 2010 om godtagbara tillgångar	20 %	Upp till 35 % under exceptionella omständigheter, t.ex. när värdepappret är mycket dominerande på den reglerade marknaden där det omsätts.	

Faktorer som kan påverka delfondernas förmåga att följa indexens resultat:

Delfondens förmåga att följa indexets resultat kan påverkas av följande faktorer:

- indexets omviktningar som följs av delfonden kan generera transaktions- och/eller handels- och/eller stämpelavgifter, förekomsten av marknadsavgifter och/eller
- på grund av mindre värderingsavvikelser som inte skulle vara sådana att beräkningen av delfondens substansvärde avbryts. Dessa avvikelser kan bero på att vissa råvaror tillfälligt inte är tillgängliga i indexet eller på exceptionella omständigheter som kan ha orsakat snedvridningar i indexviktningarna, däribland fall av tillfälligt upphävande eller tillfälligt avbrott i börsnoteringen av värdepapper i indexet.

BEGRÄNSNINGAR FÖR ATT FÖRHINDRA BETYDANDE INFLYTANDE

Dessa gränser, som gäller på SICAV-fondnivå, är avsedda att skydda SICAV-fonden mot de risker som den och emittenten kan ställas inför om SICAV-fonden skulle äga en betydande andel i ett visst värdepapper eller emittent.

Värdepapperskategori	Maximalt ägande som en % av det sammanlagda värdet för värdepapperen som utfärdas	
Värdepapper med rösträtt	Mindre än vad som skulle ge SICAV-fonden betydande ledningsinflytande	– värdepapper beskrivna i rad A (föregående tabell) – andelar av EU-medel som representerar det enda sättet en delfond kan investera i EU-medlens hemland och som följer tillämpliga artiklar i lagen av 2010
Värdepapper utan rösträtt i en och samma emittent	10 %	
Räntepapper utan rösträtt i en emittent	10 %	
Penningmarknadsinstrument från en och samma emittent	10 %	Dessa gränser kan ignoreras vid köp om de inte kan beräknas vid den tidpunkten
Andelar i en UCITS- eller UCI-fond	25 %	

FEEDERFONDER

SICAV-fonden kan skapa delfonder som kvalificerar sig som en masterfond eller feederfond. Den kan även konvertera befintliga delfonder till feederfonder eller byta en feederfond till en annan masterfond. Reglerna nedan gäller för alla delfonder som är en masterfond.

Värdepapper	Investeringskrav	Övriga villkor och krav
Andelar i masterfonden	Minst 85 % av tillgångarna.	
Derivat och kompletterande likvida tillgångar	Upp till 15 % av tillgångarna.	Derivat får endast användas i säkringssyfte. Vid mätning av derivatexponering måste delfonden kombinera sin egen direkta exponering med den exponering som skapas av masterfonden.

Masterfonden och feederfonden ska ha samma bankdagar, andelsvärderingsdagar och räkenskapsår. Bryttiderna för orderhantering måste samordnas så att andelsordrar i feederfonden kan behandlas och de resulterande andelsordrarna i masterfonden kan göras före masterfondens bryttid.

HANTERING OCH ÖVERVAKNING AV GLOBAL RISKEXPONERING

Förvaltningsbolaget använder sig av en riskhanteringsprocess som godkänts och övervakas av styrelsen och som gör det möjligt för bolaget att övervaka och mäta den övergripande riskprofilen för varje delfond. Riskberäkningar utförs varje bankdag.

Det finns tre möjliga metoder för riskmätning, så som beskrivet nedan. Förvaltningsbolaget väljer vilken metod varje delfond ska använda, baserat på delfondens investeringsstrategi. När en delfonds användning av derivat främst är för säkring och effektiv portföljförvaltning används ofta åtagandemetoden. När en delfond får använda derivat i stor utsträckning används vanligtvis Absolut VaR, såvida inte delfonden förvaltas utefter ett jämförelseindex, i vilket fall Relativt VaR används.

Styrelsen kan kräva att en delfond använder en ytterligare metod (endast som referens, men inte för att fastställa efterlevnad) och kan ändra metoden om den anser att den nuvarande metoden inte längre ger uttryck för delfondens totala marknadsexponering.

Metod	Beskrivning
Absolute Value-at-Risk (Absolut VaR)	Delfonden strävar efter att uppskatta den maximala förlust som den kan utsättas för under en månad (20 bankdagar). Kravet är att delfondens sämsta resultat inte ska överstiga en minskning på 20 % av andelsvärdet i 99 % av fallen.
Relative Value-at-Risk (Relative VaR)	Delfonden strävar efter att uppskatta den maximala förlust den kan utsättas för utöver den uppskattade maximala förlusten för ett jämförelseindex (vanligtvis ett lämpligt marknadsindex eller en kombination av index). Delfonden beräknar det belopp som med 99 % säkerhet är gränsen för hur mycket delfonden skulle kunna utvecklas sämre än jämförelseindexet under en månad (20 bankdagar). Absolut VaR i delfonden får inte överstiga två gånger jämförelseindexet.
Engagemang	Delfonden beräknar alla derivatexponeringar som om de vore direkta investeringar i de underliggande positionerna. Detta gör det möjligt för delfonden att inkludera effekterna av eventuella positioner för säkring eller kvittning samt positioner som tagits för effektiv portföljförvaltning. En delfond som använder denna metod måste säkerställa att dess totala marknadsexponering från derivatåtaganden inte överstiger 210 % av de totala tillgångarna (100 % från direktinvesteringar, 100 % från derivat och 10 % från lån).

Varje delfond som använder Absolut eller Relativt VaR-metoden måste även beräkna den förväntade bruttobelåningsgraden enligt ”BESKRIVNING AV DELFONDER”. Under vissa omständigheter kan bruttobelåningsgraden överstiga denna procentsats. Denna andel av belåningen återspeglar kanske inte tillräckligt riskprofilen för delfonderna, och bör läsas tillsammans med delfondernas placeringsinriktning och mål. Bruttobelåningsgraden är ett mått på den totala derivatanvändningen och beräknas som ”summan av nominella värden” (exponeringen för alla derivat, utan att motsatta positioner tar ut varandra). Eftersom beräkningen varken tar hänsyn till om ett visst derivat ökar eller minskar investeringsrisken, eller tar hänsyn till de olika känsligheterna i derivatinstrumentets nominella exponering mot marknadsrörelser, är det möjligt att detta inte är representativt för den faktiska investeringsrisken inom en delfond. Blandningen av derivat och syftet med derivatens användning kan variera beroende på marknadsförhållanden.

REPLIKERINGSMETODER FÖR PASSIVT FÖRVALTAD DELFOND

Form av replikering		Metod för replikering	Diversifiering (index och portfölj)	Ytterligare information
Indirekt replikering	**Ofinansierad**	För att få exponering mot indexresultat, handlar delfonden via TRS portföljens resultat mot betalning från swapmotparten för index-resultatet. I ett sådant fall är avsikten att delfondens portfölj huvudsakligen ska placeras i aktier och aktierelaterade instrument samt penningmarknadsinstrument och penningmarknadsfonder, när det gäller aktiefonder, och i omsättningsbara skuldinstrument, konvertibler och penningmarknadsfonder, när det gäller övriga fonder. Swapparnas nominella belopp justeras vanligtvis dagligen, men justeras som minimum när teckningar och inlösen tas emot av delfonden. Det kapitalbelopp av delfondens tillgångar som omfattas av totalavkastningsswappen utgör under normala förhållanden 100 % av delfondens substansvärde och som högst 100 %.	Motparten till OTC-swappen är ett första klassens finansinstitut specialiserat på denna typ av transaktion. Sådan motpart har ingen befogenhet över sammansättningen av delfondens portfölj eller över underliggande finansiella derivatinstrument. Om inget annat anges i ”BESKRIVNING AV DELFOND” omfattar swappanvändningen ingen belåning. Delfondens substansvärde kommer att öka (eller minska) enligt värderingen av OTC-swappen. Justeringar av OTC-swapkontraktets nominella värde i händelse av eventuella teckningar och inlösen kommer att utföras baserat på marknadsvärderingen. Värderingen av OTC-swappavtalen tillhandahålls av motparten, men förvaltningsbolaget gör sin egen oberoende värdering av dessa.	Information om den uppdaterade sammansättningen av den korg med tillgångar som innehas i delfonden, och motpartsrisken som medföljer swappen, finns på den sida som är avsedd för delfonden på Amundi ETF:s webbplats på amundietf.com. Frekvensen av eventuella uppdateringar och/eller det datum då informationen ovan uppdateras anges också på samma sida på ovan nämnda webbplats. Delfonden får inte ingå i några transaktioner med värdepappersutlåning.

		Den korg som innehas av delfonden kan justeras dagligen så att dess värde i allmänhet är minst 100 % av delfondens nettotillgångar. Vid behov görs denna justering för att säkerställa att marknadsvärdet för ovan nämnt OTC-swapkontrakt är mindre än eller nära noll, vilket begränsar motpartsrisken som uppstår via OTC-swappen. Förvaltaren förbehåller sig rätten att om det anges i aktuell ”BESKRIVNING AV DELFOND” inte inneha värdepapper från företag som är involverade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt närmare beskrivning i Amundis globala policy för ansvarsfulla investeringar.	Värderingen av OTC-swappavtalen kontrolleras av SICAV-fondens revisor under det årliga revisionsuppdraget. Trots alla åtgärder som SICAV-fonden vidtagit för att nå sitt replikeringsmål är dessa åtgärder föremål för oberoende riskfaktorer, inklusive men inte begränsat till förändringar i skatte- eller handelsreglerna. Ingen garanti kan lämnas till investeraren i detta avseende.	
Direkt replikering	**Full**	Delfonden kan genomföra sitt investeringsmål genom att investera i en portfölj av överlåtbara värdepapper eller andra godtagbara tillgångar som normalt kommer att omfatta de värdepapper som utgör det finansiella indexet enligt ”Beskrivning av delfond” och i en proportion som ligger mycket nära värdepapprets andel i indexet. Förvaltaren förbehåller sig rätten att inte investera (i) i värdepapper som ingår i indexet om deras viktning skulle vara för liten eller om köp eller fortsatt innehav av ett sådant värdepapper skulle vara till skada för delfondens resultat och/eller (ii) om så anges i relevant ”BESKRIVNING AV DELFOND”, i värdepapper i företag som är involverade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen, vilket beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar, i värdepapper i företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller som upprepningsvis och allvarligt kränker en eller flera av de tio principerna i Global Compact*, samt i värdepapper i företag som är verksamma inom tobaksproduktion eller -distribution eller i företag med betydande exponering mot termiskt kol eller i företag med betydande exponering mot kärnvapen eller okonventionell olja och gas. Uteslutandet av dessa värdepapper grundar sig på Amundis metod enligt beskrivningen i avsnittet ”ÖVERSIKT ÖVER POLICYN FÖR ANSVARSFULLA INVESTERINGAR”. **Förenta nationernas Global Compact (FN:s Global Compact): ”En uppmaning till företag att anpassa strategier och operationer till universella principer om mänskliga rättigheter, arbete, miljö och antikorruption och vidta åtgärder som främjar samhällets mål.”*	Delfonden kan också ingå transaktioner med finansiella derivatinstrument (”**FDI**”) i det huvudsakliga syftet att uppnå målen under (i) och (ii) nedan, inklusive terminstransaktioner, valutaswappar, terminskontrakt, icke-leveransbara valutaterminer, transaktioner till avistakurs för att (i) minska nivån för den aktiva risken (tracking error), eller (ii) optimera förvaltningen av likvida medel, eller (iii) minska transaktionskostnaderna eller möjliggöra exponering vid illikvida värdepapper eller värdepapper som inte är tillgängliga på marknaden eller av regleringsskäl, eller (iv) bidra till att uppnå investeringsmålet och ta itu med vissa lokala marknadssärdrag (marknadstillträde, likviditet, lokal skatt) och av skäl som att skapa effektiviteter när det gäller att skapa exponering mot komponenterna i det finansiella indexet eller mot det finansiella indexet i sig, eller (v) säkring mot valutarisk.	Delfonden får använda tekniker och instrument kopplade till överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument, såsom värdepappersutlåning och värdepapperslån, förutsatt att sådana tekniker och instrument används för effektiv portföljförvaltning i enlighet med ”BESKRIVNING AV DELFOND”. Användningen av sådana tekniker och instrument bör inte leda till att det förklarade investeringsmålet för någon delfond ändras eller till att delfondens angivna riskprofil ökas avsevärt. För att begränsa en delfonds exponering mot risken för motpartens fallissemang i ett återköpsavtal, erhåller delfonden kontanter eller andra tillgångar som säkerhet. Varje delfonds maximala och förväntade andelar av delfondens tillgångar som kan vara föremål för värdepapperslån eller upplåningstransaktioner under normala omständigheter definieras i tabellen ”ANVÄNDNING AV VÄRDEPAPPERSTRANSAKTIONER OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR” för varje delfond.

Direkt replikering	**Stickprov-steknik**	För att optimera metoden för direkt replikering och minska kostnaderna för att investera direkt i alla värdepapper i det finansiella indexet, kan en delfond besluta att använda en ”stickprovsteknik” som består i att investera i ett urval av representativa värdepapper i det finansiella indexet enligt relevant ”BESKRIVNING AV DELFOND”. En delfond får investera i ett urval av överlåtbara värdepapper som är representativa för det finansiella index som anges i relevant ”BESKRIVNING AV DELFOND” i proportioner som inte återspeglar deras viktning inom det finansiella indexet, så som angivet i aktuell ”Beskrivning av delfond”, samt i förekommande fall investera i värdepapper som inte ingår i det finansiella indexet. Förvaltningsbolaget förbehåller sig också rätten att inte investera i värdepapper som nämns i ii) ovan.		

FÖR PENNINGMARKNADSDELFONDER

Penningmarknadsdelfonderna är fondföretag som investerar i kortfristiga tillgångar och som har som mål, enskilt eller kumulativt, att erbjuda en avkastning i linje med penningmarknadsräntan eller bibehålla värdet på investeringen. Penningmarknadsdelfonderna förvaltas aktivt av förvaltningsbolaget eller dess delegater. Användningen av penningmarknadsinstrument är inte begränsad till syftet att förvalta fonden effektivt.

TILLÅTNA VÄRDEPAPPER OCH TRANSAKTIONER

SICAV-fonden kan skapa penningmarknadsdelfonder som kvalificerar sig som standardiserade penningmarknadsdelfonder med rörligt nettotillgångsvärde enligt förordningen om penningmarknadsfonder. Den kan även konvertera befintliga delfonder till penningmarknadsdelfonder eller en penningmarknadsdelfond till en annan delfondstyp.

Andelsägare i penningmarknadsdelfonder bör vara medvetna om att de regler som anges i förordningen om penningmarknadsfonder beträffande tillåtna värdepapper eller transaktions- och portföljdiversifiering delvis skiljer sig från dem som anges i 2010 års lag, i synnerhet gällande tillåtna tillgångar, diversifieringsregler och användning av finansiella derivatinstrument.

Förutom (i) under exceptionellt ogynnsamma marknadsförhållanden där en tillfällig överträdelse av gränsen på 20 % krävs av omständigheterna och motiveras med hänsyn till andelsägarnas intressen, får SICAV-fondens delfonder inneha upp till 20 % av sina nettotillgångar i kompletterande likvida tillgångar (enligt definitionen i punkt 7 i tabellen nedan) för att täcka löpande eller exceptionella betalningar eller under den tid som krävs för att återinvestera i godtagbara tillgångar eller under en tidsperiod som är absolut nödvändig vid ogynnsamma marknadsförhållanden.

Tabellen nedan beskriver typerna av finansiella instrument som är tillåtna för penningmarknadsdelfonder enligt förordningen om penningmarknadsfonder.

Värdepapper/transaktionskrav			
1. Godtagbara penningmarknadsinstrument	Måste vara noterade eller handlas på en officiell börs i en godkänd stat eller på en reglerad marknad i en godkänd stat med regelbunden handel som är öppen för allmänheten.	Penningmarknadsinstrument, inbegripet finansiella instrument emitterade eller garanterade individuellt eller tillsammans av Europeiska unionen, medlemsstaternas nationella, regionala och lokala myndigheter eller av deras centralbanker, Europeiska centralbanken, Europeiska investeringsbanken, Europeiska investeringsfonden, Europeiska stabilitetsmekanismen, Europeiska finansiella stabiliseringsfaciliteten, en central myndighet eller centralbank i ett tredjeland, Internationella valutafonden, Internationella banken för återuppbyggnad och utveckling, Europarådets utvecklingsbank, Europeiska banken för återuppbyggnad och utveckling, Banken för internationell betalningsutjämning eller en annan relevant internationell finansiell institution eller organisation som en eller flera medlemsstater tillhör. Det måste uppvisa någon av följande alternativa egenskaper: – det lagliga inlösendatumet vid emittering inträffar inom högst 397 dagar – det har en återstående löptid på högst 397 dagar – det har en återstående löptid fram till den lagliga inlösendagen på högst två (2) år, under förutsättning att datumet då räntan fastställs nästa gång är högst 397 dagar framåt i tiden (penningmarknadsinstrument med rörlig ränta och penningmarknadsinstrument med fast ränta som säkrats genom ett swapparrangemang ska fastställas till en penningmarknadsränta eller ett index). Penningmarknadsinstrument som emitterats eller garanterats av Europeiska unionen, en medlemsstats centrala myndighet eller centralbank, Europeiska centralbanken, Europeiska investeringsbanken, Europeiska stabilitetsmekanismen eller Europeiska finansiella stabiliseringsfaciliteten omfattas inte av förfarandet för intern bedömning av kreditkvalitet som beskrivs i avsnittet ”Förfarande för intern bedömning av kreditkvalitet som är tillämpligt på penningmarknadsdelfonder”.	marknadsvärdering när så är möjligt, annars modellvärdering
2. Penningmarknadsinstrument som inte uppfyller kraven på rad 1	Måste omfattas (antingen på emissions- eller emittentnivå) av reglering för att skydda investerare och besparingar och förutsatt att de är: – emitterade eller garanterade av en central, regional eller lokal myndighet eller en centralbank i en EU-medlemsstat, Europeiska centralbanken, EU, Europeiska investeringsbanken, en icke-medlemsstat eller, när det gäller en delstat, av en av de stater som utgör förbundsstaten eller av ett offentligt internationellt organ som en eller flera medlemsstater tillhör, eller – emitterade av en emittent eller ett företag vars värdepapper är kvalificerade enligt rad 1 ovan, eller – emitterade eller garanterade av en emittent som omfattas av EU:s tillsynsregler eller andra tillsynsregler som beaktas av CSSF som likvärdiga. Kan även vara kvalificerad om emittenten tillhör en kategori som är godkänd av CSSF, omfattas av investerarskydd som motsvarar dem som beskrivs till vänster och uppfyller ett av följande kriterier: – emitterade av ett företag med kapital och reserver på minst 10 miljoner euro och offentliggör sin årsredovisning – emitterade av en enhet som ägnar sig åt att finansiera en koncern av företag varav minst ett är börsnoterat eller av en enhet som ägnar sig åt att finansiera värdepapperiseringsinstrument som omfattas av kreditförstärkning från en bank		marknadsvärdering när så är möjligt, annars modellvärdering

3. Andelar i penningmarknadsfonder	Endast kortfristiga penningmarknadsfonder eller standardiserade penningmarknadsfonder som auktoriserats enligt förordningen om penningmarknadsfonder och: – Högst 10 % av tillgångarna i den penningmarknadsfond som investeringen avser kan, i enlighet med dess fondbestämmelser eller bolagsordning, sammanlagt investeras i andelar i andra penningmarknadsfonder. – Den penningmarknadsfond som investeringen avser innehar inga andelar i penningmarknadsdelfonden och får inte investera i penningmarknadsdelfonden under den period som penningmarknadsdelfonden innehar andelar i denna.	Om den penningmarknadsfond som investeringen avser förvaltas, antingen direkt eller indirekt eller genom delegering, av samma förvaltare som penningmarknadsdelfonden, eller av något annat företag till vilket penningmarknadsdelfondens förvaltare är kopplad genom gemensam ledning eller kontroll, eller genom ett betydande direkt eller indirekt innehav, får förvaltaren av den penningmarknadsfond som investeringen avser eller det andra företaget inte debitera tecknings- eller inlösenavgifter avseende penningmarknadsdelfondens investering i andelar i den penningmarknadsfond som investeringen avser.	Substansvärde som emitterats av den penningmarknadsfond som investeringen avser
4. Omvända återköpsavtal	De tillgångar som erhålls ska vara penningmarknadsinstrument på rad 1 och 2, ska inte säljas, återinvesteras, pantsättas eller överföras på något annat sätt och ska vara tillräckligt diversifierade och emitterade av enheter som är oberoende av och som inte förväntas uppvisa en hög korrelation med hur det går för motparten. Värdepapperiseringar och ABCP-papper ska inte erhållas av fonden som del av ett omvänt återköpsavtal. Marknadsvärdet på tillgångarna som erhålls är alltid minst lika med värdet på de belopp som betalas ut. Hela beloppet måste gå att få tillbaka när som helst, antingen inklusive upplupen ränta eller på basis av en marknadsvärdering.	De belopp som erhålls som en del av återköpsavtalet får även investeras (men får inte på annat sätt investeras i andra godtagbara tillgångar, överföras eller på annat sätt återanvändas) i andra likvida överlåtbara värdepapper eller penningmarknadsinstrument än de enligt rad 1 och 2 och tillgångar som erhålls som en del av det omvända återköpsavtalet får vara andra likvida överlåtbara värdepapper eller penningmarknadsinstrument än de enligt rad 1 och 2, förutsatt att dessa tillgångar har emitterats eller garanterats av EU, en central myndighet eller centralbank i en EU-medlemsstat, Europeiska centralbanken, Europeiska investeringsbanken, Europeiska stabilitetsmekanismen eller Europeiska finansiella stabiliseringsfaciliteten eller emitterats eller garanterats av en central myndighet eller centralbank i ett tredjeland. Tillgångar som erhålls som säkerhet måste omfattas av riktlinjer för nedsättning i full överensstämmelse med bestämmelserna i kommissionens delegerade förordning (EU) 2018/990 av den 10 april 2018 om ändring och komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1131 vad gäller enkel, transparent och standardiserad (STS) värdepapperisering och penningmarknadslån med tillgångar som säkerhet (ABCP-papper), krav för tillgångar som erhålls som en del av omvända repor samt kreditkvalitetsbedömningsmetoder. Delfonden måste ha rätt att avsluta avtalet när som helst med högst två arbetsdagars varsel.	anses vara hela beloppet därav, om inte detta sannolikt inte kommer att betalas eller erhållas till fullo, i vilket fall värdet ska fastställas efter att ett avdrag gjorts som styrelsen anser lämpligt i ett sådant fall för att återspegla det verkliga värdet
5. Återköpsavtal	Endast tillfälligt, under högst sju arbetsdagar, endast för likviditetshanteringsändamål och inte för investeringsändamål. Den motpart som erhåller de tillgångar som fonden överfört som säkerhet inom ramen för återköpsavtalet får inte sälja, investera, pantsätta eller på annat sätt överföra dessa tillgångar utan fondens förhandsgodkännande. De belopp som erhålls kan kontoplaceras som kontoplaceringar och får inte överstiga 10 %.		marknadsvärdering när så är möjligt, annars modellvärdering
6. Insättningar hos kreditinstitut	Måste kunna återbetalas på begäran eller kunna tas ut när som helst och löptiden ska vara högst tolv månader (med undantag för bankinsättningar på avistakonton).	Institutionerna måste antingen ha sitt huvudkontor i en EU-medlemsstat eller, om inte, omfattas av EU:s tillsynsregler eller andra tillsynsregler som anses likvärdiga.	anses vara hela beloppet därav, om inte detta sannolikt inte kommer att betalas eller erhållas till fullo, i vilket fall värdet ska fastställas efter att ett avdrag gjorts som styrelsen anser lämpligt i ett sådant fall för att återspegla det verkliga värdet

7. Kompletterande likvida tillgångar	Bankinsättningar på avistakonton som är tillgängliga när som helst.		
8. Derivat	Måste handlas på en reglerad marknad enligt vad som anges på rad 1 eller OTC och alla nedanstående villkor är uppfyllda: – Derivatinstrumentets underliggande komponenter består av räntor, växelkurser, valutor eller index som representerar någon av dessa kategorier. – Derivatinstrumentet har endast till syfte att säkra de inneboende ränte- eller växelkursriskerna i delfondens andra investeringar. – Motparterna vid affärer med OTC-derivat är institut som omfattas av reglering och tillsyn och tillhör de kategorier som godkänts av delfondens behöriga myndighet. – OTC-derivaten är föremål för daglig tillförlitlig och verifierbar värdering och kan vid varje tidpunkt, på fondens initiativ, säljas, lösas in eller avslutas genom en utjämnande transaktion till ett rimligt värde.	Tillgångar som erhålls som säkerhet omfattas av CSSF-cirkulär 14/592. Andra tillgångar än kontanta medel som erhålls som säkerhet ska vara tillgångar på rad 1 till 3, ska inte säljas, återinvesteras, pantsättas eller överföras på något annat sätt och ska vara tillräckligt diversifierade och emitterade av enheter som är oberoende av och som inte förväntas uppvisa en hög korrelation med hur det går för motparten. De belopp som erhålls som säkerhet kan endast kontoplaceras som kontoplaceringar eller investeras i penningmarknadsinstrument eller kortfristiga penningmarknadsfonder i enlighet med förordningen om penningmarknadsfonder. Tillgångar som erhålls som säkerhet omfattas av riktlinjer för nedsättning som beskrivs i SICAV-fondens säkerhetspolicy som finns på webbplatsen www.amundi.com	marknadsvärdering när så är möjligt, annars modellvärdering
9. Värdepapperiseringar och/eller ABCP-papper	– Måste vara tillräckligt likvid och bestå av något av följande som har ett lagligt inlösendatum vid emittering eller en återstående löptid på högst två år och den tid som återstår tills räntan fastställs nästa gång är högst 397 dagar: – En värdepapperisering som kvalificerar sig som en ”tillgång på nivå 2B” i den mening som avses i artikel 13 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2015/61 – Ett ABCP-papper som emitterats av ett ABCP-program som uppfyllde de krav som angavs i artikel 11 i förordningen om penningmarknadsfonder – En enkel, transparent och standardiserad (STS) värdepapperisering eller ABCP-papper	Måste, vad gäller en värdepapperisering, vara ett amorterande instrument och ha en vägd genomsnittlig livslängd på högst två (2) år.	marknadsvärdering när så är möjligt, annars modellvärdering

1 En penningmarknadsfond som investeringen avser anses vara kopplad till fonden om båda förvaltas eller kontrolleras av samma eller närstående förvaltningsbolag eller om fonden direkt eller indirekt innehar mer än 10 % av kapitalet eller rösträtterna i den penningmarknadsfond som investeringen avser. Andra tillgångar än de enligt rad 1 till 9, blankning, lån och utlåning av kontanta medel, direkt eller indirekt exponering mot aktier eller råvaror, inklusive via derivat, certifikat som representerar dem, index som baseras på dem eller på något annat sätt eller via något annat instrument som innebär exponering mot dem och avtal om värdepappersutlåning eller värdepapperslån eller några andra avtal som skulle belasta penningmarknadsdelfondens tillgångar är inte tillåtna.

Penningmarknadsdelfondens diversifiering och koncentrationsgränser

För att säkerställa diversifiering omfattas varje penningmarknadsdelfond av följande diversifieringsregler.

	Maximal investering/exponering, i procent av delfondens tillgångar		
Värdepapperskategori	**I en och samma emittent**	**I Samman-lagt**	**Övrigt**
A. Penningmarknadsinstrument emitterade eller garanterade individuellt eller tillsammans av Europeiska unionen, medlemsstaternas nationella, regionala och lokala myndigheter eller av deras centralbanker, Europeiska centralbanken, Europeiska investeringsbanken, Europeiska investeringsfonden, Europeiska stabilitetsmekanismen, Europeiska finansiella stabiliseringsfaciliteten, en central myndighet eller centralbank i ett OECD-land, Folkrepubliken Kina, Hongkong och/eller Singapore, Internationella valutafonden, Internationella banken för återuppbyggnad och utveckling, Europarådets utvecklingsbank, Europeiska banken för återuppbyggnad och utveckling, Banken för internationell betalningsutjämning eller en annan relevant internationell finansiell institution eller organisation som en eller flera medlemsstater tillhör.			Upp till 100 % efter auktorisering av CSSF och förutsatt att penningmarknadsdelfonden: – innehar värdepapper från minst sex olika emissioner av emittenten – begränsar investeringen i penningmarknadsfonder från samma emission till högst 30 % av tillgångarna
B. Penningmarknadsinstrument, värdepapperiseringar och ABCP-papper som emitterats av samma emittent	5 %	15 % i ett organ	Undantag: en penningmarknadsdelfond med lågvolatilt nettotillgångsvärde kan investera upp till 10 % förutsatt att det totala värdet på sådana penningmarknadsinstrument, värdepapperiseringar och ABCP-papper som innehas i varje emitterande organ i vilket den investerar mer än 5 % av sina tillgångar inte överskrider 40 % av värdet på tillgångarna. Sammanlagd exponering mot värdepapperiseringar och ABCP-papper upp till 20 % (15 % för icke-STS).
C. Insättningar som görs hos samma kreditinstitut	10 %		
D. OTC-derivat med annan motpart	5 %		
E. Andelar i penningmarknadsfonder	5 % i en penning-mark-nadsfond som investe-ringen avser		Högst 17,5 % sammanlagt i de penningmarknadsfonder som investeringen avser. Om 10 % eller mer investeras i den penningmarknadsfond som investeringen avser ska delfonden ange den maximala andel av förvaltningsavgifter som får debiteras penningmarknadsdelfonden själv och andra penningmarknadsfonder i vilka den investerar och i sin årsrapport ange den maximala andel av förvaltningsavgifter som debiteras penningmarknadsdelfonden själv och andra penningmarknadsfonder i vilka den investerar.
F. Obligationer emitterade av ett enskilt kreditinstitut som har sitt säte i en medlemsstat och enligt lag omfattas av särskild offentlig tillsyn avsedd att skydda obligationsinnehavare.	10 %		Kapital som härrör från emission av sådana obligationer ska investeras i tillgångar som, under obligationernas hela giltighetstid, kan täcka de med obligationerna förenade fordringarna och som i händelse av emittentens fallissemang med prioritet ska användas för återbetalning av kapitalbelopp och upplupen ränta. Om en penningmarknadsdelfond investerar mer än 5 % av sina tillgångar i sådana obligationer som har samma emittent, får det totala värdet av dessa investeringar inte överstiga 40 % av värdet av fondens tillgångar.
G. obligationer emitterade av ett enskilt kreditinstitut, om kraven i artikel 10.1 f eller 11.1 c i den delegerade förordningen (EU) 2015/61 är uppfyllda.	20 %		Om en penningmarknadsdelfond investerar mer än 5 % av sina tillgångar i sådana obligationer som har samma emittent, får det totala värdet av dessa investeringar inte överstiga 60 % av värdet av fondens tillgångar.
H. Omvända återköpsavtal			Tillgångar som erhålls: exponering mot en viss emittent på 15 %, förutom när dessa tillgångar består av penningmarknadsinstrument som uppfyller kraven på 100 % undantag enligt rad 1. Det totala belopp som tillhandahålls samma motpart upp till 15 %.

Företag som ingår i en koncern som upprättar koncernredovisning enligt direktiv 2013/34/EU om årsbokslut, koncernredovisning och rapporter i vissa typer av företag eller i enlighet med erkända internationella redovisningsregler ska räknas som ett organ vid beräkningen av begränsningarna ovan.

En penningmarknadsfond eller penningmarknadsdelfond ska anses vara en separat penningmarknadsfond för beräkningen av begränsningarna ovan.
En penningmarknadsdelfond kan inte inneha rösträtt som skulle göra det möjligt att utöva väsentligt inflytande över ledningen hos en emittent.
Dessutom får högst 10 % av penningmarknadsinstrumenten, värdepapperiseringarna och ABCP-papperen i en penningmarknadsdelfond vara emitterade av ett enda organ. Denna begränsning ska inte gälla för penningmarknadsinstrument emitterade eller garanterade av Europeiska unionen, medlemsstaternas nationella, regionala och lokala myndigheter eller av deras centralbanker, Europeiska centralbanken, Europeiska investeringsbanken, Europeiska investeringsfonden, Europeiska stabilitetsmekanismen, Europeiska finansiella stabiliseringsfaciliteten, en central myndighet eller centralbank i ett tredjeland, Internationella valutafonden, Internationella banken för återuppbyggnad och utveckling, Europarådets utvecklingsbank, Europeiska banken för återuppbyggnad och utveckling, Banken för internationell betalningsutjämning eller en annan relevant internationell finansiell institution eller organisation som en eller flera medlemsstater tillhör.

Portföljregler för standardiserade penningmarknadsdelfonder

En standardiserad penningmarknadsdelfond ska kontinuerligt uppfylla samtliga nedanstående krav:
- Portföljen ska alltid ha en vägd genomsnittlig löptid på högst sex månader.
- Portföljen ska alltid ha en vägd genomsnittlig livslängd på högst tolv månader, om inte annat följer av andra och tredje styckena.
- Minst 7,5 % av tillgångarna ska utgöras av tillgångar som förfaller dagligen, omvända återköpsavtal som kan sägas upp med en arbetsdags varsel eller kontanta medel som kan tas ut med en arbetsdags varsel. En standardiserad penningmarknadsdelfond får inte förvärva några andra tillgångar än sådana som förfaller dagligen om förvärvet skulle resultera i att den penningmarknadsdelfonden investerar mindre än 7,5 % av portföljen i tillgångar som förfaller dagligen.
- Minst 15 % av tillgångarna ska utgöras av tillgångar som förfaller på veckobasis, omvända återköpsavtal som kan sägas upp med fem arbetsdagars varsel eller kontanta medel som kan tas ut med fem arbetsdagars varsel. En standardiserad penningmarknadsdelfond får inte förvärva några andra tillgångar än sådana som förfaller på veckobasis om förvärvet skulle resultera i att den penningmarknadsdelfonden investerar mindre än 15 % av portföljen i tillgångar som förfaller på veckobasis.
- Vid beräkningen som anges ovan får penningmarknadsinstrument eller andelar i andra penningmarknadsfonder inkluderas i de tillgångar som förfaller på veckobasis upp till 7,5 %, förutsatt att de kan lösas in och avvecklas inom fem arbetsdagar.

När den vägda genomsnittliga livslängd som avses i den andra punkten ovan beräknas för värdepapper, inklusive strukturerade finansiella instrument, ska en standardiserad penningmarknadsdelfond basera beräkningen av löptiden på den återstående löptiden fram till laglig inlösen av instrumenten. Om ett finansiellt instrument omfattar en säljoption får dock en standardiserad penningmarknadsdelfond basera beräkningen av löptiden på lösendagen för denna säljoption i stället för den återstående löptiden, men endast om samtliga följande villkor alltid är uppfyllda:
- Säljoptionen kan utnyttjas fritt av den standardiserade penningmarknadsdelfonden på lösendagen.
- Lösenpriset för säljoptionen ligger nära instrumentets förväntade värde på lösendagen.
- Den standardiserade penningmarknadsdelfondens investeringsstrategi innebär att det är hög sannolikhet att optionen kommer att lösas in på lösendagen.

Genom undantag får en standardiserad penningmarknadsdelfond vid beräkningen av den vägda genomsnittliga livslängden för värdepapperiseringar och ABCP-papper, när det gäller amorterande instrument, i stället basera beräkningen av löptiden på antingen
- den kontraktsenliga amorteringsprofilen för sådana instrument, eller
- amorteringsprofilen för de underliggande tillgångarna från vilka kassaflödena för inlösen av sådana instrument härrör.

Om de gränsvärden som anges ovan överskrids av skäl som ligger utanför penningmarknadsdelfondens kontroll eller till följd av att teckningsrätter eller rätter till inlösen utnyttjas, ska penningmarknadsdelfonden prioritera korrigering av detta förhållande under vederbörligt hänsynstagande till andelsägarnas intressen.
En standardiserad penningmarknadsdelfond får inte ha formen av en statspapperbaserad penningmarknadsdelfond med fast nettotillgångsvärde eller en penningmarknadsdelfond med lågvolatilt nettotillgångsvärde.

Förfarande för intern bedömning av kreditkvalitet som är tillämpligt på penningmarknadsdelfonder

Beskrivning av förfarandets syfte:

Förvaltningsbolaget bär det slutliga ansvaret för att upprätta, genomföra och fortlöpande tillämpa ett förfarande för intern bedömning av kreditkvalitet för att fastställa kreditkvaliteten för penningmarknadsinstrument, värdepapperiseringar och ABCP-papper vilkas egenskaper har definierats enligt följande:
- Syftet med förfarandet för intern bedömning av kreditkvalitet är att upprätta principer och metoder som måste tillämpas systematiskt för att fastställa krediternas investerbara kvalitet för SICAV-fonden i enlighet med förordningen om penningmarknadsfonder. Förfarandet specificerar processen genom vilken bland annat försämrade krediter bör övervakas för att undvika att behålla krediter som kan drabbas av fallissemang.
- Förfarandet för intern bedömning av kreditkvalitet har definierats av kreditriskkommittén under förvaltningsbolagets ansvar.
- Kreditriskkommittén hålls på Amundi-koncernnivå och är oberoende av investeringsteamen.
- Ett oberoende team för kreditanalys och hantering av gränser som verkar under förvaltningsbolagets ansvar, på Amundi-koncernnivå och baserat i Paris (Frankrike) genomför de metoder som är tillämpliga på alla viktiga skeden i investeringscykeln: insamling av information, analyser och bedömningar av kreditkvalitet, rekommendationer för validering av kreditriskkommittén, övervakning av krediter som valideras av kommittén, specifik övervakning av försämrade krediter och kritiska fall, hantering av fall då gränser överträtts.
- Metoderna granskas och valideras så många gånger som krävs och minst en gång om året för att anpassa dem till den aktuella portföljen och till de yttre omständigheterna. Om metoderna ändras granskas alla berörda interna kreditbedömningar så snart som möjligt i enlighet med förordningen om penningmarknadsfonder.
- Krediter som är godtagbara för penningmarknadsfonderna granskas minst en gång om året och så många gånger som krävs av utveckling som påverkar kreditkvaliteten.

Beskrivning av indata för bedömningen av kreditkvalitet:
Metoderna för bedömning av kreditkvaliteten behandlar lönsamhet, solvens och likviditet, baserat på specifika kvantitativa och kvalitativa element som varierar beroende på typen av emittenter (nationella, regionala och lokala myndigheter, finansiella företag och icke-finansiella företag) och typen av tillgångsklass/instrument (utan kreditbetyg, värdepapperiserat, säkerställt, efterställt osv.).

Metoderna tar hänsyn till kvantitativa och kvalitativa indikatorer som gör det möjligt att på ett försiktigt, systematiskt och permanent sätt bedöma informationens tillförlitlighet och synlighet på kort och medellång sikt för bärkraften för emittenten (både ur ett inneboende perspektiv och i det sammanhang där emittenten verkar) och emissionerna.

De aktuella kriterier som används för analysen varierar beroende på typen av emittenter och deras verksamhetssektorer. Följande element beaktas:

- Kvantitativa indikatorer, såsom rapporterade operativa och finansiella uppgifter, analyseras inte bara vid bokslut, utan även som utveckling över tid, och omprövas vid behov för att uppskatta lönsamhet, solvens, risk för fallissemang och likviditetskvoter som anses vara så representativa som möjligt.
- Kvalitativa indikatorer, såsom tillgång till finansiering, drift och företagsledning, strategi, bolagsstyrning och anseende, utvärderas beträffande konsekvens, trovärdighet eller genomförbarhet på kort och medellång sikt samt i ljuset av den makroekonomiska situationen och finansmarknadssituationen.
- Tillgångens/instrumentets kortfristiga natur.
- För strukturerade finansiella instrument, den inneboende operativa risken och motpartsrisken i den strukturerade finansiella transaktionen och, vid exponering mot värdepapperiseringar, emittentens kreditrisk, värdepapperiseringens struktur samt kreditrisken i de underliggande tillgångarna.
- Informationskällorna är av tillräcklig, mångsidig, aktuell och tillförlitlig kvalitet, baserat på ett effektivt system, och består av:
- Vid källan: årsrapporter och publikationer på emittenternas webbplatser, presentationer av emittenter i samband med bilaterala möten eller turnéer.
- På marknaden: muntliga eller skriftliga presentationer av kreditvärderingsinstitut, intern/extern analys från säljsidan eller medier/ offentlig information.

Beskrivning av kreditkvalitetsbedömningsmetoden:

Bedömningen av kreditkvaliteten ger upphov till en rekommendation som anger en riskkodnivå och en gräns per förvaltningsenhet. Riskkoderna respresenterar de olika nivåerna av kreditkvalitet med en skala från 1 (solid) till 6 (låg). Vid utveckling och händelser som påverkar kvaliteten på krediterna negativt i olika allvarlighetsgrad nedgraderas riskkoderna i enlighet därmed, till de lägsta riskkoderna 4, 5 eller 6. Det förekommer inte någon mekanisk förlitan på externa kreditbetyg. En ny kvalitetsbedömning genomförs om det skett en väsentlig ändring som skulle kunna påverka den befintliga bedömningen av emittenten och instrumentet, enligt vad som krävs och regleras enligt relevant förordning som utfärdats av Esma.

Gränserna fastställs enligt kreditkvaliteten, storleken på emittenten och andelen i emittentens konsoliderade skuld. Kreditriskkommittén sammanträder varje månad och vid behov när som helst på tillfällig basis och validerar kreditrekommendationerna som måste förhandsvalideras av den chef som ansvarar för kreditriskanalysen och hanteringen av gränserna.

Kreditriskkommitténs ordförande är Amundi-koncernens vice verkställande direktör och i hans frånvaro chefen för risk i Amundi-koncernen. Kommittén består även av permanenta ledamöter som är chefer (och i deras frånvaro, deras suppleanter) för de övervakade affärsområdena, inklusive penningmarknader, efterlevnad och revision, och chefer för riskhantering och kreditanalys inom affärsområdet risk.

Kreditrekommendationer som valideras av kreditriskkommittén kommuniceras till förvaltningsbolaget som ska granska och validera dem med lämplig frekvens. Avvikelse från rekommendationer ska kommuniceras till kreditriskkommittén och den chef som ansvarar för kreditriskanalysen och hanteringen av gränserna för beaktande av förvaltningsbolagets uppfattning.
Vid en överträdelse tillämpas det relevanta förfarandet för att reglera situationen:

- omedelbar försäljning av de tillgångar som står för överträdelsen för att överensstämma med gränserna, eller
- avveckling av förvaltningen av de tillgångar som står för överträdelsen som sedan följs av ett överskott, om det är motiverat, eller
- ökning av gränsen som absorberar överskottet, om det är motiverat.

Dessa beslut måste dokumenteras skriftligen enligt artikel 7 i den delegerade förordningen (EU) 2018/990.

Likviditetshantering och kundkännedom

Investeringsförvaltaren av en penningmarknadsdelfond tillämpar konsekvent förfaranden för likviditetshantering för att bedöma en penningmarknadsdelfonds förmåga att upprätthålla en lämplig likviditetsnivå under beaktande av likviditetsprofilerna för den aktuella delfondens olika tillgångar och fondkoncentration och volatila flöden som förväntas utifrån andelsägarnas relaterade kundkännedomsinformation (som innehåller element som storlek, korrelation mellan dem och tidigare beteenden) och andra skulder som påverkar penningmarknadsdelfondens tillgångar.

Investerarna i penningmarknadsdelfonderna ska tillhandahålla och auktorisera mellanhänder att tillhandahålla information som begärs av SICAV-fonden, förvaltningsbolaget, investeringsförvaltaren eller en delegat för att förvaltningsbolaget ska kunna uppfylla kraven på kundkännedom i artikel 27 i förordningen om penningmarknadsfonder. Denna information ska bland annat inbegripa typ av investerare, antal andelar som ägs av en investerare och in- och utflödenas utveckling för en investerare.

Denna information skulle begäras för att förvaltningsbolaget ska kunna ta hänsyn till (a) mönster som går att identifiera i investerarnas likviditetsbehov, inklusive den cykliska utvecklingen av antalet andelar i den aktuella penningmarknadsdelfonden, (b) investerarnas riskaversion och (c) graden av korrelation eller nära koppling mellan investerare i syfte att förvaltaren på lämpligt sätt ska kunna hantera likviditeten och investerarkoncentrationen eller den aktuella penningmarknadsdelfonden.

ANVÄNDNING AV BLOCKKEDJOR

ANVÄNDNING AV BLOCKKEDJOR

Prenumerationer på och inlösen av tokeniserade andelsklasser kommer att registreras i SICAV-fondens officiella andelsägarregister via blockkedjan.

Dessa andelar registreras i den specifikt avsedda distribuerade databastekniken (DLT), närmare bestämt i blockkedjan, en typ av DLT som organiserar data i en länkad kedja av block. Ur teknisk synpunkt är andelarna fortfarande registrerade, men de representeras i form av token. Andelsägare måste se till att bokföring och överlåtelse av deras andelar hanteras via en personlig plånbok som tilldelats dem och som administreras under överinseende av registrerings- och överlåtelseombudet. För att undvika missförstånd vill vi klargöra att den delfond, via vilken dessa andelar erbjuds, investerar inte i tillgångar kopplade till blockkedjan. Registreringen av delfondens andelar på blockkedjan påverkar inte delfondens investeringar.

Investerare som vill använda sin egen plånbok måste först få den godkänd av registrerings- och överlåtelseombudet. Vi vill påminna investerarna om att deras andelar registreras på en offentlig blockkedja. Investerarna bekräftar och godkänner uttryckligen att antalet tokens som representerar deras investering i dessa andelar kan vara synliga för allmänheten. Trots denna synlighet innehåller inte informationen som är tillgänglig via blockkedjan någon personlig identifierbar information eller data som direkt identifierar enskilda andelsägare.

En blockkedja är en distribuerad databasteknik som på ett säkert sätt registrerar transaktioner mellan två parter på ett verifierbart och oföränderligt sätt med hjälp av kryptografiska tekniker. Transaktioner på blockkedjan verifieras och godkänns av datorer i nätverket, som tar emot, sprider, verifierar och utför dessa transaktioner. Denna autentiseringsprocess av en transaktion innan den registreras i huvudboken säkerställer att endast giltiga och godkända transaktioner sparas permanent på blockkedjan i grupper av transaktioner. Varje blockkedjenätverk drivs av en programvarukällkod som definierar och styr dess kryptografiska system för transaktionsverifiering.

Investerare som vill investera i tokeniserade andelsklasser i de aktuella delfonderna kan göra det genom att följa den vanliga processen, som beskrivs i avsnittet om ”köp, byte, inlösen och överlåtelse av andelar” i detta prospekt.

För att underlätta användningen av blockkedjeteknik kommer registrerings- och överlåtelseombudet att behandla ansökningsformuläret och bekräfta investerarens kontoskapande innan en blockkedjebaserad plånbok skapas för investeraren eller innan en befintlig blockkedjebaserad plånbok som tillhör investeraren utvärderas och godkänns.

Om resultatet av AML/KYC-kontrollerna är tillfredsställande öppnas ett konto och en plånbok tilldelas investeraren. Så snart andelsägaren tilldelas en sådan plånbok kan deras order behandlas i det elektroniskt distribuerade registret. En plånbok är i allmänhet ett program som lagrar en användares privata nyckel och tillhörande digitala tillgångar, och används för att underlätta överföring av tillgångar på en specifik blockkedja. En privat nyckel används av en plånboksägare för att skicka digitalt signerade och verifierade instruktioner till blockkedjan, i syfte att uppdatera ägarinformationen för digitala tillgångar. Den är personlig och tillhör endast innehavaren av plånboken. En motsvarande ”offentlig nyckel” är offentlig, och ger andra plånböcker på den aktuella blockkedjan möjlighet att överföra tillgångar till en plånboks offentliga nyckeladress när så är tillåtet.

Om en privat nyckel stjäls eller förloras, så är vanligtvis plånboken utsatt och alla digitala tillgångar som är kopplade till den kan bli otillgängliga för innehavaren och/eller drabbas av olaglig förskingring. Den privata nyckeln förvaltas av registrerings- och överlåtelseombudet och omfattas av kontroller som syftar till att minska risken för felaktiga eller otillåtna transaktioner med andelarna. Men även plånböcker skapade av en extern plånboksleverantör kan godkännas av registrerings- och överlåtelseombudet. I ett sådant fall kommer andelsägaren ansvara för alla risker som är förknippade med denna plånbok.

Token präglas i det elektroniskt distribuerade registret och tilldelas sedan andelsägarens plånbok.

Efter att det präglats återspeglas tokenet i registrerings- och överlåtelseombudets standardsystem för registerföring.

SICAV-fonden använder för närvarande Ethereums publika blockkedjenätverk, och andelsägarnas plånböcker kommer finnas på detta nätverk. Förvaltningsbolaget kan emellertid komma att godkänna ytterligare blockkedjenätverk i framtiden. Tillstånd att förvara en plånbok på ett annat nätverk än Ethereum är förbehållet att det beviljas av registrerings- och överlåtelseombudet samt förvaltningsbolaget.

Offentliga blockkedjenätverk kräver betalning av transaktionsavgifter för att verifiera transaktioner. Dessa avgifter, som vanligtvis betalas i blockkedjans egna digitala valuta, bidrar till att skydda nätverket mot obehöriga eller skadliga aktiviteter. Investerare behöver inte köpa några nativa digitala tillgångar för att kunna genomföra transaktioner på blockkedjan.

SICAV-fonden och/eller förvaltningsbolaget förbehåller sig rätten att ompröva lämpligheten hos de blockkedjenätverk som används.

Användningen av blockkedjeteknik är fortfarande relativt ny inom fondförvaltningsbranschen och medför särskilda risker. Dessa beskrivs närmare i avsnittet om ”Riskbeskrivningar” i detta prospekt.

MER OM DERIVAT OCH TEKNIKER

TYPER AV DERIVAT SOM DELFONDERNA FÅR ANVÄNDA

Ett derivat är ett finansiellt kontrakt vars värde är avhängigt av resultatet för en eller flera underliggande tillgångar (till exempel ett värdepapper eller en värdepapperskorg, ett index eller en ränta).
Även om delfondens specifika placeringsinriktning inte utesluter användningen av någon typ av derivat utgör följande typer för närvarande de vanligaste derivat som används av delfonderna (se avsnittet ”Regler relaterade till penningmarknadsdelfonder” i detta prospekt för penningmarknadsdelfonder):
Kärnderivat – kan användas av alla delfonder, i enlighet med dess placeringsinriktning

- finansiella terminer
- optioner, såsom optioner på aktier, räntor, index, obligationer, valutor
- warrants på råvaruindex
- terminer, såsom valutakontrakt
- swappar (kontrakt där två parter utbyter avkastningen från två olika tillgångar, index eller korgar av samma), såsom utländsk valuta, ränta, men däri ingår INTE totalavkastningsswappar, kreditswappar, råvaruindexswappar, volatilitet eller variansswappar.

Ytterligare derivat – alla avsikter till användning av dessa framgår av ”BESKRIVNINGEN AV DELFONDERNA”

- Totalavkastningsswappar (kontrakt där en part överför till en annan part det totala resultatet av en referenstillgång, inklusive alla räntor, avgiftsinkomster, marknadsvinster eller förluster och kreditförluster). Totalavkastningsswappar som ingås av delfonderna är i form av ofinansierade swappar. En ofinansierad swap är en swap där ingen inledande förskottsbetalning görs av mottagaren av den totala avkastningen. En finansierad swap är en swap där mottagaren av den totala avkastningen betalar ett förskottsbelopp i utbyte mot den totala avkastningen på referenstillgången. Finansierade swappar tenderar att vara dyrare på grund av kravet på förskottsbetalning.
- Kreditderivat, såsom kreditswappar (kontrakt där en konkurs, betalningsinställelse eller annan kredithändelse utlöser en betalning från den ena parten till den andra).
- TBA-derivat (terminskontrakt på en generisk pool med bolån; övergripande egenskaper hos denna pool anges men de exakta värdepapper som ska levereras till köparen bestäms två dagar före leverans, istället för tidpunkten för den ursprungliga handeln).
- Strukturerade finansiella derivat, till exempel kredit- och aktielänkade värdepapper.
- CFD-kontrakt (kontrakt vars värde baseras på skillnaden mellan två referensmätningar), såsom en korg med värdepapper.

Terminer handlas vanligtvis på börsen. Alla andra typer av derivat är i allmänhet OTC. För alla indexlänkade derivat bestämmer indexleverantören hur ofta de ska ombalanseras.

SYFTE MED DERIVATANVÄNDNING

I enlighet med sin placeringsinriktning kan en delfond som inte är en penningmarknadsdelfond använda derivat för säkring mot olika typer av risker, för en effektiv portföljförvaltning eller för att få exponering mot vissa investeringar eller marknader. Penningmarknadsdelfonder kan endast använda derivat för att säkra de inneboende ränte- eller växelkursriskerna i den aktuella penningmarknadsdelfondens andra investeringar.

Valutasäkring
En delfond kan genomföra valutasäkring på andelsklassnivå för säkrade andelsklasser i syfte att säkra mot valutakursförändringar mellan en klass valuta och den valuta eller de valutor som delfondens investeringar är noterade i. I vissa fall (H1-andelsklasser) kan delfonden genomföra valutasäkring på andelsklassnivå för säkrade andelsklasser i syfte att säkra mot valutakursförändringar mellan andelsklassens valuta och den berörda delfondens basvaluta.

Även om detta inte är avsikten kan det leda till över- eller undersäkrade positioner på grund av yttre faktorer som ligger utanför delfondens kontroll.
Bolaget ska, vad gäller den berörda delfonden, se till att undersäkrade positioner inte understiger 95 % av den andel av en klass substansvärde som ska säkras, samt kontinuerligt övervaka eventuella undersäkrade positioner för att säkerställa att dessa inte förs vidare från månad till månad. Översäkrade positioner kommer inte att överstiga 105 % av den säkrade andelsklassens substansvärde, och de säkrade positionerna övervakas kontinuerligt för att säkerställa att positioner som väsentligt överstiger 100 % av substansvärdet inte förs vidare från månad till månad.
Om det uppstår en förlust på valutasäkringen för den berörda säkrade andelsklassen före en justering eller återställning, kommer den berörda säkrade andelsklassen att ha en exponering mot värdepapper som överstiger dess substansvärde. Detta beror på att substansvärdet består av både värdet på de underliggande värdepapperen och den orealiserade förlusten på valutasäkringen. Omvänt gäller att om det uppstår en vinst på valutasäkringen för den berörda säkrade andelsklassen före en justering eller återställning, kommer den berörda säkrade andelsklassen att ha en lägre exponering mot värdepapper än dess substansvärde, eftersom substansvärdet i detta fall inkluderar en orealiserad vinst på valutasäkringen. De berörda säkrade andelsklasserna ska enskilt stå för eventuella kostnader i samband med sådan säkring. Alla vinster/förluster som kan uppkomma för en delfonds säkrade andelsklasser till följd av sådana säkringstransaktioner ska tillfalla den berörda säkrade andelsklassen. Säkringstransaktioner ska tydligt kunna hänföras till de berörda säkrade andelsklasserna.

Säkring av ränta
Uppnås vanligtvis via delfondens användning av ränteterminer, ränteswappar eller genom olika varianter av köp- eller säljoptioner på räntor.

Säkring av kreditrisk
En delfond kan använda kreditswappar för att säkra kreditrisken för sina tillgångar. Detta inkluderar säkringar mot risker för specifika tillgångar eller emittenter samt säkringar mot värdepapper eller emittenter mot vilka delfonden inte är direkt exponerad.

Säkring av duration
Syftar till att minska exponeringen mot parallella ränteväxlingar längs kurvorna. Sådan säkring kan ske på delfondnivå.

Effektiv portföljförvaltning
De delfonder som inte är penningmarknadsdelfonder kan använda alla tillåtna derivat för en effektiv portföljförvaltning. Effektiv portföljförvaltning omfattar kostnadsreducering, kontanthantering, ett ordnat underhåll av likviditet och relaterade rutiner (till exempel att upprätthålla 100 % investeringsexponering samtidigt som en del av tillgångarna hålls likvida för att hantera inlösen av andelar och köp och försäljning av investeringar). Effektiv portföljhantering omfattar inte några aktiviteter som skapar belåning på den övergripande portföljnivån.

Skapa exponering
De delfonder som inte är penningmarknadsdelfonder kan använda alla tillåtna derivat i stället för direktinvesteringar, det vill säga för att få investeringsexponering mot värdepapper, marknader, index, ränta eller instrument som är förenliga med delfondens investeringsmål och placeringsinriktning. Denna exponering får överstiga den som skulle erhållas genom direktinvesteringar i den positionen (hävstångseffekt).
En delfond kan också sälja en kreditswapp som ett sätt att skapa en specifik kreditexponering. Försäljningen av en kreditswapp kan generera stora förluster om emittenten eller värdepappret som swappen baseras på går i konkurs, hamnar på obestånd eller drabbas av någon annan ”kredithändelse”.

TEKNIKER OCH INSTRUMENT FÖR TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING

I enlighet med sin placeringsinriktning får varje delfond använda de tekniker och instrument vid transaktioner för värdepappersfinansiering som beskrivs i detta avsnitt. Penningmarknadsdelfonder omfattas

av specifika begränsningar som beskrivs närmare under ”Regler relaterade till penningmarknadsdelfonder”.
Varje delfond ska se till att den alltid kan uppfylla sina inlösenskyldigheter gentemot andelsägare och sina leveransskyldigheter gentemot motparter.

Ingen delfond får sälja, pantsätta eller ställa som säkerhet värdepapper som erhållits genom dessa kontrakt.

Ut- och inlåning av värdepapper

Vid ut- och inlåning av värdepapper överlåter en långivare värdepapper eller instrument till en låntagare, förutsatt att låntagaren återlämnar likvärdiga värdepapper eller instrument på ett framtida datum eller på begäran av långivaren. Värdepapper och instrument som kan vara föremål för utlåningstransaktioner inkluderar aktier, obligationer, penningmarknadsinstrument och börshandlade fonder.

Genom sådana transaktioner får en delfond låna ut värdepapper eller instrument till en motpart som omfattas av tillsynsregler som av CSSF beaktas som likvärdiga dem som föreskrivs i EU-lagstiftningen.

En annan delfond än en penningmarknadsdelfond kan låna ut portföljvärdepapper eller instrument antingen direkt eller genom något av följande:

– ett standardiserat lånesystem organiserat av ett erkänt clearinginstitut
– ett lånesystem organiserat av en finansiell institution som är specialiserad på den typen av transaktioner.

Låntagaren måste erbjuda en garanti (i form av säkerheter) som sträcker sig över hela låneperioden och är minst lika med den globala värderingen av de utlånade värdepapperen, och därtill värdet av varje värderingsavdrag som anses lämpligt med hänsyn till säkerhetens kvalitet.

Varje delfond som inte är en penningmarknadsdelfond kan endast låna värdepapper under exceptionella omständigheter, såsom:

– när värdepapper som har lånats ut inte återlämnas i tid
– när delfonden av externa skäl inte kunde leverera värdepapper när den var skyldig till det.

Omvända återköp och återköpsavtal

Vid dessa transaktioner köper respektive säljer delfonden värdepapper, och har antingen åtaganderätten eller skyldigheten att sälja tillbaka respektive återköpa värdepapperen vid ett senare tillfälle och till ett visst pris.

En delfond får ingå återköpsavtal endast med motparter som omfattas av tillsynsregler som CSSF anser vara likvärdiga med dem som föreskrivs i EU-lagstiftningen.

De värdepapper och motparter som är tillåtna för dessa åtgärder måste följa CSSF-cirkulär 08/356 (för andra delfonder än penningmarknadsdelfonder) och CSSF-cirkulär 13/559 och CSSF-cirkulär 14/592 och förordningen om penningmarknadsfonder för penningmarknadsdelfonder.

HANTERING AV SÄKERHETER FÖR OTC-DERIVATTRANSAKTIONER OCH TEKNIKER OCH INSTRUMENT FÖR TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING

När en annan delfond än en penningmarknadsdelfond ingår OTC-derivattransaktioner, däribland totalavkastningsswappar, och tillämpar tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering bör alla säkerheter som används för att minska exponeringen mot motpartsrisker följa Esmas riktlinjer 2014/937 och CSSF-cirkulär 14/592.

Godtagbara säkerheter

Som en del av OTC-derivattransaktioner (inklusive totalavkastningsswappar) och tillfälliga köp och försäljningar av värdepapper kan den delfond som inte är en penningmarknadsdelfond erhålla värdepapper och kontanter som garanti (säkerhet). Närmare uppgifter om penningmarknadsdelfondens regler om godtagbar säkerhet finns i avsnittet ”Regler relaterade till penningmarknadsdelfonder” i detta prospekt.

En säkerhet som erhålls i annat än kontanter ska vara av hög kvalitet, vara mycket likvid och omsättas på en reglerad marknad eller en multilateral handelsplattform med transparent kurssättning så att den kan säljas snabbt till en kurs som är nära värderingen före försäljningen.

Den bör vara tillräckligt diversifierad i fråga om land, marknader, emission och emittenter och får inte på sammanlagd basis medföra en exponering mot en given emittent på mer än 20 % av substansvärdet.

Värdepapper som erhålls som säkerhet, i överensstämmelse med och som angivet i CSSF-cirkulär 08/356 (för andra delfonder än penningmarknadsdelfonder), måste efterleva de kriterier som fastställts av förvaltningsbolaget.

De måste vara:
– vara likvida
– kunna överlåtas när som helst
– vara diversifierade i enlighet med fondens godtagbarhetsregler, exponering och diversifiering
– vara emitterade av en emittent som inte är en enhet tillhörande motparten eller dess koncern och som inte förväntas uppvisa en hög korrelation med motpartens resultat.

För obligationer emitteras även värdepapper av högkvalitativa emittenter som är belägna inom OECD, vars lägsta betyg får vara mellan AAA och BBB- enligt Standard & Poor’s betygsskala eller med ett betyg som bedöms vara likvärdigt av förvaltningsbolaget. Obligationer måste ha en maximal löptid på 50 år.

Mottagna kontanta säkerheter bör endast (i) sättas in hos enheter som föreskrivs i artikel 41.1 f i lagen av 2010, (ii) investeras i statsobligationer av hög kvalitet, (iii) användas för omvända repotransaktioner under förutsättning att transaktionerna sker med kreditinstitut som är föremål för tillsyn och att den berörda delfonden när som helst kan återkalla hela kontantbeloppet på upplupen basis, (iv) investerat i kortfristiga penningmarknadsfonder enligt definitionen i riktlinjerna för en gemensam definition av europeiska penningmarknadsfonder.

Dessa kriterier beskrivs i en riskpolicy som finns på webbplatsen på www.amundi.com och kan komma att ändras, särskilt i händelse av exceptionella marknadsförhållanden.

Alla tillgångar som erhålls som säkerhet bör efterleva ESMA:s riktlinjer 2012/832 avseende likviditet, värdering, emittentens kreditkvalitet, korrelation och diversifiering med en maximal exponering mot en given emittent på 20 % av nettotillgångarna.

De tillgångar som mottas som säkerhet hålls i förvar av förvaringsinstitutet.

Värdering av säkerheter:

Mottagna säkerheter värderas dagligen till marknadspris (marknadsvärderingsmetoden).

Värderingsavdrag kan tillämpas på den mottagna säkerheten (som beror på typ och deltyper av säkerheter), med beaktande av kreditkvalitet, prisvolatilitet och eventuella stresstestresultat. Skuldförbindelser baseras nämligen på typen av emittent och dessa värdepappers löptid. Större värderingsavdrag tillämpas för aktier.

Marginalsäkerheter görs dagligen, om inte annat föreskrivs i ett ramavtal som omfattar dessa transaktioner, om det har avtalats med motparten att tillämpa en utlösningströskel.

SICAV-fondens säkerhetspolicy ställs till investerarnas förfogande på webbplatsen www.amundi.com

Återinvestering av tillgångar som tillhandahålls som garanti

Kontanta medel som tillhandahålls som garanti kan endast återinvesteras i enlighet med CSSF-cirkulär 08/356 (för andra delfonder än penningmarknadsdelfonder).

Andra tillgångar som tillhandahålls som garanti kommer inte att återanvändas.

Se avsnittet ”Regler relaterade till penningmarknadsdelfonder” för regler relaterade till penningmarknadsdelfonder om återinvestering av kontanta medel.

Driftskostnader

Nettointäkterna (som representerar bruttointäkterna minus direkta och indirekta driftskostnader och avgifter) från tekniker och instrument för transaktioner för värdepappersfinansiering förblir hos berörd delfond.

Direkta och indirekta driftskostnader och avgifter kan dras av från de bruttointäkter som levereras till delfonden. Dessa kostnader utgör 35 % av bruttointäkterna och betalas till Amundi Intermediation för dess roll som låneombud för värdepapper. Med de 35 % som Amundi Intermediation erhåller täcker man sina egna avgifter och kostnader och betalar alla relevanta indirekta avgifter och kostnader (inklusive 5 % till CACEIS som agerar som säkerhetsombud).

Sådana direkta avgifter och kostnader fastställs i enlighet med marknadspraxis och i överensstämmelse med de nuvarande marknadsnivåerna. Resterande 65 % av bruttointäkterna går till fonden.

Från och med prospektdatumet fungerar Amundi Intermediation som ombud för värdepappersutlåning.
De ansvarar för val av motpart och bästa utförande.

Förvaringsinstitutet, Caceis Bank, Luxembourg Branch, agerar som säkerhetsförvaltare och utför avräkning av värdepapperslån.

Både Amundi Intermediation och Caceis Bank, Luxembourg Branch är närstående parter i förvaltningsbolaget, Amundi Luxembourg S.A. Sådana transaktioner kan utföras med närstående parter, som tillhör Credit Agricole Group såsom Crédit Agricole CIB och CACEIS.

De motparter med vilka värdepapperstransaktioner ingår kommer att framgå av SICAV-fondens årsrapport.

SAMMANFATTNING AV PROCESSEN FÖR VAL AV MELLANHÄNDER

En rigorös urvalsprocess tillämpas för mäklare och finansiella mellanhänder.

Urvalet
– gäller endast finansiella institutioner i OECD-länder vars minimibetyg varierar mellan AAA och BBB- enligt Standard & Poor’s, vid tidpunkten för transaktionerna, eller anses vara likvärdiga av förvaltningsbolaget enligt dess egna kriterier och
– görs bland ansedda finansiella mellanhänder på grundval av flera kriterier som rör tillhandahållande av analystjänster (fundamental finansiell analys, företagsinformation, mervärde från partner, solid grund för rekommendationer osv.) eller utförandetjänster (tillgång till marknadsinformation, transaktionskostnader, utförandepriser, god praxis för transaktionsavveckling osv.).

Dessutom kommer var och en av de motparter som behålls att analyseras med hjälp av riskavdelningens kriterier, såsom land, finansiell stabilitet, betyg, exponering, typ av aktivitet, tidigare resultat osv.

Urvalsförfarandet, som genomförs årligen, omfattar de olika parterna i front office och support-avdelningar.
De mäklare och finansiella mellanhänder som väljs genom detta förfarande kommer övervakas regelbundet i enlighet med förvaltningsbolagets genomförandepolicy.

När det gäller valet av motparter för delfonders TRS med hjälp av en indirekt replikeringsmetod, utfärdades en omfattande ”Request for Proposal” (”**RFP**”) för delfonder knutna till aktieindex och för delfonder knutna till ränteindex.

En motpart har valts ut för att tillhandahålla totalavkastningsswappen och marknadsgarantin för varje delfondssegment. Vid tidpunkten för detta prospekt har BNP Paribas SA eller något annat bolag i BNP Paribas SA-koncernen valts ut för delfonder knutna till aktieindex, medan Société Générale Corporate and Investment Banking eller något annat företag i Société Générale-koncernen som motparter eller mellanhänder har valts för delfonder knutna till obligationsindex.

ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR

De delfonder som inte är penningmarknadsdelfonder kommer inte att använda köp- och återförsäljningstransaktioner, sälj- och återköpstransaktioner, återköpsavtal eller omvända återköpsavtal, värdepapperslån och marginalutlåning i den mening som avses i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 av den 25 november 2015 om transparens i transaktioner för värdepappersfinansiering och om återanvändning.

Penningmarknadsdelfonderna kommer inte att använda några andra tekniker för en effektiv portföljförvaltning än de som anges i tabellen i avsnittet ”Värdepapper och transaktioner som är tillåtna för penningmarknadsdelfonden”.

I enlighet med tabellen nedan använder delfonderna löpande och/eller tillfälligt transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar.

1. PASSIVT FÖRVALTADE DELFONDER

De delfonder som tillämpar en indirekt replikering kommer att tillämpa TRS för att erhålla exponering mot indexresultat.

De delfonder som tillämpar en direkt replikering kan ingå värdepappersutlåning för att generera ytterligare intäkter. Som ett exempel i enlighet med tabellen nedan kan användningen av teknik och instrument för värdepappersfinansieringstransaktioner av en delfond styras av marknadsförhållanden eller särskilda möjligheter som är mindre förutsägbara.

Uppskattningsprocentsatser saknas därför i begränsade fall eller är mer benägna att fluktuera över tiden.

Delfonder som ingår värdepapperslån kan sannolikt påverkas av starka variationer i samband med marknadsmöjligheter. Volymen av användningen av denna teknik i syfte att optimera intäkterna kommer sannolikt påverkas av den förväntade avkastningen med hänsyn till marknadens riskaptit. Under perioder med hög efterfrågan (t.ex. låntagarens efterfrågan på att låna aktier från den underliggande marknaden) kan andelen av delfondens nettotillgångar som är föremål för transaktioner för värdepappersutlåning närma sig den maximala procentsatsen. Men det kan också finnas perioder där efterfrågan från marknaden att låna de underliggande värdepapperen är liten eller ingen, och i detta fall kan denna andel vara 0 %.

Dessutom och med förbehåll för ovanstående, en delfond som indikerar en löpande tillämpning av en viss teknik eller ett visst instrument, betraktar i allmänhet dem som en del av ett permanent program och/eller som en del av förvaltningsprocessen och kommer att ha uppskattningar som är mindre benägna att fluktuera (även om delfonderna ibland inte får ha några utestående affärer i sin redovisning).

DELFONDER MED DIREKT REPLIKERING

DELFONDER	Värdepapperslån - förväntad (%)	Värdepapperslån - max (%)	Värdepapperslån - användningsvillkor (om tillämpligt)	TRS - förväntad (%)	TRS - max (%)	TRS - användningsvillkor (om tillämpligt)
Amundi CAC 40 ESG	13 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi China CNY Bonds	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core DAX	10 %	33 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
AMUNDI DAX 50 ESG	5 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EMU Screened	5 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi DJ Switzerland Titans 30	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi DIVDAX	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core EUR Corporate Bond	20 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi EUR Corporate Bond 0-1Y ESG	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi EUR Corporate Bond 1-5Y ESG	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi EUR Floating Rate Corporate Bond ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi EUR High Yield Corporate Bond ESG	25 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi EUR Short Term High Yield Corporate Bond ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi USD High Yield Corporate Bond ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi USD Floating Rate Corporate Bond ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi USD Corporate Bond Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core USD Corporate Bond	5 %	33 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi US Treasury Bond 0-1Y	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–

Amundi Global Government Tilted Green Bond	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi STOXX Europe 600 ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core STOXX Europe 600	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi SDAX	20 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Luxury (från och med 21.09.2026)	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime USA	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core US Treasury Bond	40 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime UK MID And Small Cap	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime Japan	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime Global Government Bond	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime Eurozone	10 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime Europe	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime Euro Government Bond	40 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime Euro Government Bond 0-1Y	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Prime Emerging Markets	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Gold Miners	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI World ESG Broad Transition	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI World Climate Paris Aligned	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI USA SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI USA ESG Selection	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI UK IMI SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Smart Cities	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Robotics & AI	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi EUR Corporate Bond 0-3Y ESG	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Pacific Ex Japan SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Pacific ESG Broad Transition	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI North America ESG Broad Transition	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Nordic	1 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Japan SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Japan ESG Broad Transition	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Europe SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Europe Small Cap ESG Broad Transition	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Europe Growth	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad Transition	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Europe ESG Broad Transition	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Europe Climate Paris Aligned	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EMU SRI Climate Paris Aligned	0 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EMU Small Cap ESG Broad Transition	15 %	20 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EMU ESG Selection	0 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EMU ESG Broad Transition	5 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EMU Climate Paris Aligned	5 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Broad Transition	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Emerging Ex China ESG Selection	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Selection	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EM Asia SRI Climate Paris Aligned	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI EM Asia ESG Broad Transition	0 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI China Tech	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi USD Emerging Markets Government Bond	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI China ESG Selection	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Ac Far East Ex Japan ESG Selection (till den 14 oktober 2026)	0 %	35 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Emerging Markets Screened (från och med den 15 oktober 2026)	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MDAX ESG	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–

Amundi Lifecycle 2039	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Lifecycle 2036	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Lifecycle 2033	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Lifecycle 2030	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Italy MIB ESG	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Italy BTP Government Bond 10Y	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Italy BTP Government Bond 1-3Y	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi USD Corporate Bond ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Index MSCI World	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core MSCI Europe	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core MSCI Emerging Markets	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core Global Government Bond	25 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi FTSE EPRA NAREIT Global	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi EUR Corporate Bond ESG	20 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Aggregate Bond ESG	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond 1-3Y	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Government Bond Highest Rated Investment Grade	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Treasury Bond	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Inflation-Linked Bond Select	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global High Yield Corporate Bond ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y Highest Rated ESG	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Corporate IG	5 %	10 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Corporate Bond	5 %	33 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Bioenergy	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core Global Aggregate Bond	25 %	50 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Aggregate Bond 1-5Y ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Aggregate Bond ESG	5 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2029 Euro Government Bond Broad	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2028 Euro Government Bond Yield +	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2028 Euro Government Bond Broad	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2027 Italy BTP Government Bond	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2027 German Bund Government Bond	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2027 Euro Government Bond Broad	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2026 Euro Government Bond Broad	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi F.A.Z. 100	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro STOXX Select Dividend30	15 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core Euro STOXX 50	15 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro High Yield Bond ESG	25 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Government Tilted Green Bond	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Government Low Duration Tilted Green Bond	0 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Government Bond 25+Y	30 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core Euro Government Bond	40 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi STOXX Europe Defense	9 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Singapore Straits Times	7 %	30 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Europe Screened	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Core GBP Corporate Bond	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Fixed Maturity 2030 Euro Government Bond Broad	30 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Global Small Cap OECD Ex USA	9 %	10 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global Government Bond GDP-Weighted	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Global ex-US Government Bond	25 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi Euro Stoxx	10 %	25 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi US TIPS Ultrashort	60 %	70 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–
Amundi MSCI Emerging Ex-China	10 %	45 %	Tillfälligt	0 %	0 %	–

DELFONDER MED INDIREKT REPLIKERING

DELFONDER	Värdepap-perslån - för-väntad (%)	Värdepap-perslån - max (%)	Värdepap-perslån - användnings-villkor (om tillämpligt)	TRS - förvän-tad (%)	TRS - max (%)	TRS - använd-ningsvillkor (om tillämp-ligt)
Amundi STOXX Europe Select Dividend 30	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi ShortDAX Daily (-1X) Inverse	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi S&P 500 Buyback	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi S&P 500 Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Russell 2000	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Global Luxury (till och med 20.09.2026)	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi PEA MSCI USA ESG Selection	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi PEA Dow Jones Iindustrial Average	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Nasdaq-100 Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Core MSCI World Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI World Ex Europe	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI World Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI USA Minimum Volatility Factor	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI Switzerland	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI India Swap II	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI Europe Value Factor	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI Europe Quality Factor	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI Europe Momentum Factor	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI Europe Minimum Volatility Factor	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI Europe High Dividend Factor	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI Emerging Markets Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI EM Latin America	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi MSCI EM Asia	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Core MSCI China A Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi JPX-NIKKEI 400	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Japan Topix	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi FTSE EPRA NAREIT Global II	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi FTSE Epra Europe Real Estate	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Nasdaq-100 Target Income	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Euro STOXX 50 Target Income	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Core MSCI USA Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande
Amundi Core MSCI ACWI Swap	0 %	0 %	–	100 %	100 %	Löpande

2. AKTIVT FÖRVALTADE DELFONDER

PENNINGMARKNADSDELFONDER:

DELFONDER	Återköpsavtal – förväntat (%)	Återköpsavtal – högst (%)	Återköpsavtal – användningsvillkor (om tillämpligt)	Omvänt återköpsavtal – förväntat (%)	Omvänt återköpsavtal – högst (%)	Omvända återköpsavtal – användningsvillkor (om tillämpligt)
Amundi EUR Cash Active	5,0 %	10 %	Tillfälligt	5,0 %	70 %	Löpande
Amundi USD Cash Active	5,0 %	10 %	Tillfälligt	5,0 %	70 %	Löpande

REGELVERK FÖR JÄMFÖRELSEINDEX

De index som anges nedan tillhandahålls, vid tidpunkten för detta prospekt, av indexadministratörer som tillämpar de övergångsarrangemang som föreskrivs i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 av den 8 juni 2016 om index som används som referensvärden för finansiella instrument och finansiella avtal eller för att mäta investeringsfonders resultat ("**referensvärdesförordningen**") och anges därmed inte i det register över administratörer och jämförelseindex som ESMA innehar i enlighet med artikel 36 i referensvärdesförordningen.

Jämförelseindexadministratör	Juridiskt namn för jämförelseindexadministratören	Index	Delfond
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Lifecycle 2039 Screened Select Index	Amundi Lifecycle 2039
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Lifecycle 2036 Screened Select Index	Amundi Lifecycle 2036
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Lifecycle 2033 Screened Select Index	Amundi Lifecycle 2033
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Lifecycle 2030 Screened Select Index	Amundi Lifecycle 2030
TOPIX	Tokyo Stock Exchange, Inc.	TOPIX	Amundi Japan Topix
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Eurozone Target Maturity Government Bond Italy (Mid Price) Index	Amundi Italy BTP Government Bond 10Y
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Eurozone Italy Government 1-3Y (Mid Price) Index	Amundi Italy BTP Government Bond 1-3Y
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index	Amundi FTSE EPRA NAREIT Global
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG 1-3Y Index	Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond 1-3Y
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Eurozone Lowest- Rated Government Bond IG Index	Amundi Euro Lowest Rated IG Government Bond
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index	Amundi Euro Government Bond Highest Rated Investment Grade
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE EPRA/NAREIT Developed Index	Amundi FTSE EPRA NAREIT Global II
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe	Amundi FTSE Epra Europe Real Estate
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Euro Broad Government 2029 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2029 Euro Government Bond Broad
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Euro Yield+ Government 2028 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2028 Euro Government Bond Yield +
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Euro Broad Government 2028 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2028 Euro Government Bond Broad
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Italy Government 2027 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2027 Italy BTP Government Bond
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE German Government 2027 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2027 German Bund Government Bond
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Euro Broad Government 2027 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2027 Euro Government Bond Broad
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Euro Broad Government 2026 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2026 Euro Government Bond Broad
FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE Euro Broad Government 2030 Maturity Index	Amundi Fixed Maturity 2030 Euro Government Bond Broad

FTSE	FTSE INTERNATIONAL LIMITED	FTSE GDP-Adjusted World Government Bond Index	Amundi Global Government Bond GDP-Weighted

De index som anges nedan tillhandahålls på prospektdatumet av administratörer av referensvärden som anges i registret enligt artikel 36 i referensvärdesförordningen som auktoriserad administratör i enlighet med artikel 34 i referensvärdesförordningen.

Jämförelseindexadministratör	**Juridiskt namn för jämförelseindexadministratören**	**Index**	**Delfond**
STOXX	STOXX Limited	DAX 50 ESG+ NR	AMUNDI DAX 50 ESG
Euronext	Euronext Paris SA	CAC 40 ESG	Amundi CAC 40 ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index	Amundi China CNY Bonds
Stoxx	STOXX Limited	DAX INDEX	Amundi Core DAX
MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU Screened Select ex-Thermal Coal Index	Amundi MSCI EMU Screened
S&P	S&P Dow Jones Indices LLC	Dow Jones Switzerland Titans 30 Total Return Index	Amundi DJ Switzerland Titans 30
Stoxx	STOXX Limited	DivDAX Total Return Index	Amundi DIVDAX
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Euro Corporate Bond Index	Amundi Core EUR Corporate Bond
Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index	Amundi EUR Corporate Bond 0-1Y ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate 1-5 Year Select Index	Amundi EUR Corporate Bond 1-5Y ESG
Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA	Amundi EUR Floating Rate Corporate Bond ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate High Yield Select Index	Amundi EUR High Yield Corporate Bond ESG
Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index	Amundi EUR Short Term High Yield Corporate Bond ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG US Corporate High Yield Select Index	Amundi USD High Yield Corporate Bond ESG
Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA	Amundi USD Floating Rate Corporate Bond ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI USD Corporate PAB Select Index	Amundi USD Corporate Bond Climate Paris Aligned
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI	AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg US Corporate Liquid Issuer Index	Amundi Core USD Corporate Bond
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg US Short Treasury Index	Amundi US Treasury Bond 0-1Y

Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Global Treasury Green Bond Tilted Index	Amundi Global Government Tilted Green Bond
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg US TIPS Ultrashort Laddered Index	Amundi US TIPS Ultrashort
Stoxx	STOXX Limited	STOXX Europe Select Dividend 30 Index	Amundi STOXX Europe Select Dividend 30
Stoxx	STOXX Limited	STOXX Europe 600 ESG+ Index	Amundi STOXX Europe 600 ESG
Stoxx	STOXX Limited	STOXX Europe 600 Index	Amundi Core STOXX Europe 600
Stoxx	STOXX Limited	SDAX Total Return Index	Amundi SDAX
S&P	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P Global Luxury	Amundi Global Luxury
S&P	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P 500 Scored and Screened+ Index (USD) NTR	Amundi S&P 500 Screened
S&P	S&P Dow Jones Indices LLC	S&P 500 Buyback	Amundi S&P 500 Buyback
S&P	S&P Dow Jones Indices LLC	500 S&P	Amundi S&P 500 Swap
Russell	FRANK RUSSELL COMPANY ("Russell")	Russell 2000	Amundi Russell 2000
Solactive	Solactive AG	Solactive GBS United States Large & Mid Cap	Amundi Prime USA
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg U.S. Treasury Index	Amundi Core US Treasury Bond
Solactive	Solactive AG	Solactive United Kingdom Mid and Small Cap ex Investment Trust	Amundi Prime UK MID And Small Cap
Solactive	Solactive AG	Solactive GBS Japan Large & Mid Cap	Amundi Prime Japan
Solactive	Solactive AG	Solactive Global Developed Government Bond	Amundi Prime Global Government Bond
Solactive	Solactive AG	Solactive GBS Developed Markets Eurozone Large & Mid Cap Index	Amundi Prime Eurozone
Solactive	Solactive AG	Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR	Amundi Prime Europe
Solactive	Solactive AG	Solactive Eurozone Government Bond	Amundi Prime Euro Government Bond
Solactive	Solactive AG	Solactive Eurozone Government Bond 0-1 Year Index	Amundi Prime Euro Government Bond 0-1Y
Solactive	Solactive AG	Solactive GBS Emerging Markets Large & Mid Cap USD	Amundi Prime Emerging Markets
MSCI	MSCI Limited	MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped	Amundi PEA MSCI USA ESG Selection
S&P	S&P Dow Jones Indices LLC	Dow Jones Industrial Average Index	Amundi PEA Dow Jones Industrial Average
S&P	S&P Dow Jones Indices LLC	Solactive Developed Markets Pure Gold Miners Index NTR (USD)	Amundi Gold Miners
Nasdaq	Nasdaq Copenhagen A/S	NASDAQ-100	Amundi Nasdaq-100 Swap
MSCI	MSCI Limited	MSCI World SRI filtered PAB Index	Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned

MSCI	MSCI Limited	MSCI WORLD	Amundi Core MSCI World Swap
MSCI	MSCI Limited	MSCI World ex Europe	Amundi MSCI World Ex Europe
MSCI	MSCI Limited	MSCI World ESG Broad CTB Select Index	Amundi MSCI World ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI WORLD	Amundi MSCI World Swap
MSCI	MSCI Limited	MSCI USA SRI filtered PAB Index	Amundi MSCI USA SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI USA Minimum Volatility	Amundi MSCI USA Minimum Volatility Factor
MSCI	MSCI Limited	MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index	Amundi MSCI USA ESG Selection
MSCI	MSCI Limited	MSCI UK IMI filtered PAB Index	Amundi MSCI UK IMI SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI Switzerland	Amundi MSCI Switzerland
MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI IMI Smart Cities Filtered	Amundi MSCI Smart Cities
MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI IMI Robotics & AI Filtered	Amundi MSCI Robotics & AI
MSCI	MSCI Limited	MSCI ACWI Net TR USD Index	Amundi Core MSCI ACWI Swap
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Euro Corp BBB+ 0-3 Year Select Index	Amundi EUR Corporate Bond 0-3Y ESG
MSCI	MSCI Limited	MSCI Pacific ex Japan SRI filtered PAB Index	Amundi MSCI Pacific Ex Japan SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index	Amundi MSCI Pacific ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI North America ESG Broad CTB Select Index	Amundi MSCI North America ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI Nordic Countries	Amundi MSCI Nordic
MSCI	MSCI Limited	MSCI Japan SRI Filtered PAB Index	Amundi MSCI Japan SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index	Amundi MSCI Japan ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI India	Amundi MSCI India Swap II
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Value	Amundi MSCI Europe Value Factor
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe SRI filtered PAB Index	Amundi MSCI Europe SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index	Amundi MSCI Europe Small Cap ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Quality	Amundi MSCI Europe Quality Factor
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Momentum	Amundi MSCI Europe Momentum Factor
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Minimum Volatility	Amundi MSCI Europe Minimum Volatility Factor

MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe High Dividend Yield	Amundi MSCI Europe High Dividend Factor
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Growth	Amundi MSCI Europe Growth
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad CTB Select	Amundi MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index	Amundi MSCI Europe ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered PAB Index	Amundi MSCI Europe Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU SRI filtered PAB Index	Amundi MSCI EMU SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Custom Net EUR Index	Amundi MSCI EMU Small Cap ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index	Amundi MSCI EMU ESG Selection
MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU ESG Broad CTB Select Net Total Return Index	Amundi MSCI EMU ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered PAB Index	Amundi MSCI EMU Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB Index	Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index	Amundi MSCI Emerging Markets ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets	Amundi MSCI Emerging Markets Swap
MSCI	MSCI Limited	MSCI EM ex China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index	Amundi MSCI Emerging Ex China ESG Selection
MSCI	MSCI Limited	MSCI EM ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index	Amundi MSCI Emerging Markets ESG Selection
MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets Latam	Amundi MSCI EM Latin America

MSCI	MSCI Limited	MSCI EM Asia SRI filtered PAB Index	Amundi MSCI EM Asia SRI Climate Paris Aligned
MSCI	MSCI Limited	MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Net USD Index	Amundi MSCI EM Asia ESG Broad Transition
MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets Asia	Amundi MSCI EM Asia
MSCI	MSCI Limited	MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect Filtered Index	Amundi MSCI China Tech
MSCI	MSCI Limited	MSCI China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index	Amundi MSCI China ESG Selection
MSCI	MSCI Limited	MSCI China A Index	Amundi Core MSCI China A Swap
MSCI	MSCI Limited	MSCI Ac Far East ex Japan ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index	Amundi MSCI AC Far East ex Japan ESG Selection (till den 14 oktober 2026)
MSCI	MSCI Limited	MSCI EM Screened Select ex-Thermal Coal Index	Amundi MSCI Emerging Markets Screened (från och med den 15 oktober 2026)
Stoxx	STOXX Limited	MDAX ESG+ (NR) EUR Index	Amundi MDAX ESG
Nikkei	Tokyo Stock Exchange, Inc.	JPX-Nikkei 400	Amundi JPX-NIKKEI 400
Euronext	Euronext Paris SA	MIB ESG Index	Amundi Italy MIB ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG US Corporate Select Index	Amundi USD Corporate Bond ESG
MSCI	MSCI Limited	MSCI World	Amundi Index MSCI World
MSCI	MSCI Limited	MSCI EUROPE Index	Amundi Core MSCI Europe
MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets	Amundi Core MSCI Emerging Markets
MSCI	MSCI Limited	MSCI Emerging Markets ex China Index	Amundi MSCI Emerging Ex-China
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate Select Index	Amundi EUR Corporate Bond ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Euro Aggregate Sector Neutral Select Index	Amundi Euro Aggregate Bond ESG

Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Global Aggregate Treasuries Index	Amundi Global Treasury Bond
J.P. Morgan	J.P. Morgan Securities LLC	J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Year Tilted Index	Amundi Global Inflation-Linked Bond Select
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Global Corporate High Yield Select Index	Amundi Global High Yield Corporate Bond ESG
J.P. Morgan	J.P. Morgan Securities LLC	J.P. Morgan EMBI Global Diversified Select Index	Amundi USD Emerging Markets Government Bond
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Global Corporate A+ 1-5 Year Select Index	Amundi Global Corporate Bond 1-5Y Highest Rated ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Global Corporate IG select	Amundi Global Corporate IG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Global Aggregate Corporate Index	Amundi Global Corporate Bond
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Global Corporate 1-5 Year Select Index	Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg BioEnergy Screened Index	Amundi Global Bioenergy
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Global Aggregate	Amundi Core Global Aggregate Bond
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sector Neutral Select Index	Amundi Global Aggregate Bond 1-5Y ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized Sector Neutral Select Index	Amundi Global Aggregate Bond ESG
Solactive	Solactive AG	F.A.Z Index	Amundi F.A.Z. 100
Stoxx	STOXX Limited	EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index	Amundi Euro STOXX Select Dividend30
Stoxx	STOXX Limited	EURO STOXX 50	Amundi Core Euro STOXX 50
Markit	IHS Markit Benchmark Administration Limited	iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA	Amundi Euro High Yield Bond ESG
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index	Amundi Euro Government Tilted Green Bond

Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index	Amundi Euro Government Low Duration Tilted Green Bond
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index	Amundi Euro Government Bond 25+Y
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Euro Treasury 50bn Bond Index	Amundi Core Euro Government Bond
Stoxx	STOXX Limited	STOXX Europe Total Market Defense Capped Index	Amundi STOXX Europe Defense
MSCI	MSCI Limited	MSCI Europe Screened ex-Thermal Coal Index	Amundi MSCI Europe Screened
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Sterling Corporate Bond Index	Amundi Core GBP Corporate Bond
MSCI	MSCI Limited	MSCI World ex USA OECD Custom Countries Small Cap Index	Amundi MSCI Global Small Cap OECD Ex USA
Bloomberg	Bloomberg Index Services Limited ("BISL")	Bloomberg Global Treasury Large Markets DM ex US Index	Amundi Global ex-US Government Bond
Nasdaq	Nasdaq Copenhagen A/S	Nasdaq - 100 8% Income Target Index	Amundi Nasdaq-100 Target Income
Stoxx	STOXX Limited	EURO STOXX 50 Covered Call Target Income 8% Index	Amundi Euro STOXX 50 Target Income

Förvaltningsbolaget har antagit en skriftlig plan med åtgärder som det kommer vidta med avseende på delfonderna om indexet väsentligt förändras eller upphör att tillhandahållas (”**beredskapsplanen**”), i enlighet med artikel 28.2 i referensvärdesförordningen. En kopia av beredskapsplanen kan erhållas kostnadsfritt och på begäran via bolagets och förvaltningsbolagets säte.

INVESTERA I DELFONDERNA

Praktisk information (som senaste substansvärde, transparenspolicy och information om tillgångarnas sammansättning i delfonden) finns på webbplatserna amundi.com och amundietf.com.

Andelsklasser

Inom varje delfond kan SICAV-fonden skapa och emittera andelsklasser med olika egenskaper och godtagbarhetskrav för investerare. Varje andelsklass identifieras först med en märkning av den basandelsklassen (enligt tabellen nedan) och sedan med tillämpliga ändelser (enligt tabellen nedan).

BASBETECKNINGAR FÖR ANDELSKLASSER

Notera att även om förhandsgodkännande från styrelsen inte är nödvändigt för att äga en viss andelsklass, krävs sådant godkännande alltid för att fungera som distributör av en viss andelsklass. Även om alla minsta initiala investeringsbelopp anges i amerikanska dollar, är minimibeloppet för alla andelsklasser i andra valutor än US-dollar det motsvarande beloppet i den andelsklassens valuta. För teckningsavgifter kan du vara berättigad att betala mindre än de maximala belopp som visas. Konsultera en finansiell rådgivare. För en komplett lista över delfonder och andelsklasser som för närvarande finns tillgängliga, gå till amundi.lu/amundi-index-solutions

				MAXIMALA AVGIFTER					
				ANDELSTRANSAKTIONER			ÅRSVIS		
Klassbeteckning	**Tillgänglig för**	**Styrelsens godkännande krävs?**	**Lägsta belopp för första investering***	**Köp****	**Byte**	**Inlösen****	**Förvaltning**	**Administration**	**Utdelning**
A	Alla investerare	Nej	Ingen	5,50 %	1,00 %	1,00 %	2,00 %	0,50 %	Ingen
A med specifika villkor	Se hemsidan www.amundi.lu/amundi-index-solutions	Ja***	Ingen	5,50 %	1,00 %	1,00 %	2,00 %****	0,50 %	Ingen
I	Institutionella investerare	Nej	500 000 USD	3,50 %	1,00 %	1,00 %	1,00 %	0,40 %	Ingen
I med särskilda villkor	Se hemsidan www.amundi.lu/amundi-index-solutions	Ja	Se hemsidan www.amundi.lu/amundi-index-solutions	3,50 %	1,00 %	1,00 %	1,00 %****	0,40 %	Ingen
M	Italienska GPF och fondföretag, UCI-fonder, mandat eller pensionsfonder	Ja	Ingen	3,50 %	1,00 %	1,00 %	1,00 %	0,50 %	Ingen
O	Institutionella investerare eller feederfonder som förvaltas eller distribueras av ett Amundi-koncernbolag	Ja	500 000 USD	6,00 %	1,00 %	1,00 %	Ingen	0,50 %	Ingen
R	Reserverad för förmedlare eller leverantörer av individuella portföljförvaltningstjänster som är förbjudna, enligt lag eller avtal från att behålla incitament	Nej	Ingen	5,50 %	1,00 %	1,00 %	1,00 %	0,50 %	Ingen
X	Institutionella investerare	Nej	USD 5 miljoner	5,00 %	1,00 %	Ingen	0,80 %	0,40 %	Ingen
UCITS ETF	Auktoriserad aktör på primärmarknaden Alla investerare på sekundärmarknaden	Nej	1 000 000 USD Ingen	3,00 %	1,00 %	3,00 %	1,00 %	0,40 %	Ingen
UCITS ETF 2	Auktoriserad aktör på primärmarknaden Alla investerare på sekundärmarknaden	Nej	1 000 000 USD Ingen	3,00 %	2,00 %	3,00 %	1,00 %	0,40 %	Ingen

De särskilda villkoren för andelsklasser betecknas med ett nummer.
* I syfte för lägsta belopp för första investering sammanställer vi investeringarna i en given investerare (eller grupp av enheter som ägs av samma moderbolag) över hela SICAV-fonden (alla andelsklasser och alla delfonder). Minimibelopp gäller i US-dollar eller motsvarande belopp i någon annan valuta.
**Maximala avgifter inkluderar (i) de maximala inköps- eller inlösenavgifterna och (ii) fasta tecknings- eller inlösenavgifter som kan debiteras EXF- och UCITS ETF-andelsklasserna.
***Med undantag för A3- och A4-andelsklasser där inget styrelsegodkännande krävs för att investera.
**** Inom detta högsta belopp kan de faktiska förvaltningsavgifterna som tillämpas på vissa I- och A-andelsklasser med specifika villkor variera i enlighet med de förvaltade tillgångarna som rör sådana andelsklasser.

SUFFIX FÖR ANDELSKLASSER

SICAV emitterar två typer av aktier: ETF-andelsklasser och index-andelsklasser.

ETF-andelsklasser denomineras som ”UCITS ETF”.

Index-andelsklasser följs inte av något suffix eller av ”Index”.
I förekommande fall kan en eller flera ändelser läggas till basandelsklassen för att ange vissa egenskaper.

Valutaändelser för alla andelsklasser utom UCITS ETF-andelsklasser.

Dessa är av två typer:

Huvudtypen är en eller två bokstäver som utgör en del av den faktiska andelsklassens beteckning och anger den primära valuta i vilken andelarna är denominerade.
Följande är de valutaändelser med en eller två bokstäver som används för närvarande och den valuta som anges (för definitioner av valutaförkortningar, se sidan 4):

A: AUD	CA: CAD	G: GBP	K: CZK	S: SGD
C: CHF	E: EUR	J: JPY	P: PLN	U: USD
SK: SEK	R: RON	F: HUF	N: NOK	MX: MXN
TB: THB	HK: HKD			

Om ingen valuta anges är andelksklassens valuta samma som basvalutan för delfonden.
Valutaändelser för UCITS ETF-andelsklasser. Dessa anger den primära valuta i vilken UCITS ETF-andelar är denominerade. Dessa anges av tillämplig valutakod med tre bokstäver.

Om ingen valuta anges är andelksklassens valuta samma som basvalutan för delfonden.

EXF anger, för alla andelsklasser, förutom UCITS ETF-andelsklasserna, att utspädningsavgift i form av tecknings-/inlösenavgifter är avsedda för andelsklassen och kommer debiteras för de sammanlagda kostnaderna för köp och/eller försäljning av underliggande investeringar i samband med sådana teckningar eller inlösen.

För UCITS ETF-andelsklasserna gäller, även om ändelsen EXF inte läggs till, in-/utträdesavgifter på den primära marknaden för sådana andelsklasser.

(C), (D) eller Acc, Dist Dessa anger om andelar är tillväxtandelar (C) eller Acc eller utdelande andelar (D) eller Dist (se ”Utdelningspolicy” nedan).

H för alla andelsklasser med undantag för UCITS ETF -andelsklasser eller HEDGED for UCITS ETF-andelsklasser Indikerar att andelarna är valutasäkrade. Valutasäkringen syftar till att eliminera effekten av valutakursfluktuationer mellan andelsklassens valuta och valutaexponering i den berörda delfondens portfölj.

H1 för alla andelsklasser: Indikerar att andelarna är valutasäkrade. För H1-andelsklasserna syftar valutasäkringen till att eliminera effekten av valutakursfluktuationer mellan andelsklassens valuta och berörd delfonds basvaluta.

I praktiken är det dock osannolikt att säkringen kommer eliminera 100 % av skillnaden, eftersom delfondernas kassaflöden, växelkurser och marknadspriser ständigt förändras. För mer information om valutasäkring, se avsnittet ”Mer om derivat och tekniker – tekniker och instrument för värdepapper”.

DLT avser att andelarna representeras av ett token som är registrerat på en blockkedja. För att teckna eller överlåta andelar med denna beteckning krävs godkännande från förvaltningsbolaget.

Antalet Indikerar att andelarna är begränsade till vissa investerare, distributörer eller länder.

DR anger när den används i en UCITS ETF-andelsklass att delfonden förvaltas med hjälp av en direkt replikeringsmetod.

Alla andelsklasser har inte detta suffix även om en delfond hanteras med en direkt replikeringsmetod. Replikeringsmetoden beskrivs i delfondens investeringspolicy.

TILLGÄNGLIGA KLASSER

Alla andelsklasser och kategorier är inte tillgängliga i alla delfonder, och vissa andelsklasser (och delfonder) som är tillgängliga i vissa jurisdiktioner kanske inte är tillgängliga i andra.

SICAV-fonden förbehåller sig rätten att endast erbjuda en andelsklass för teckning i en viss jurisdiktion i syfte att följa lokal lagstiftning, sedvänja, affärspraxis eller SICAV-fondens kommersiella mål.

För den senaste informationen om tillgängliga andelsklasser, gå till amundi.lu/amundi-index-solutions och/eller amundietf.com eller begär en lista kostnadsfritt från det registrerade kontoret, se avsnittet ”SICAV-fonden”.

ANDELSKLASSER BASERADE PÅ BLOCKKEDJOR

Andelsklasser kan vara tokeniserade, vilket innebär att teckningar och inlösen i sådana andelsklasser inom den aktuella delfonden sker via blockkedjan och registreras i SICAV-fondens officiella andelsägarregister, som beskrivs närmare i avsnittet om ”Köp, byte, inlösen och överlåtelse av andelar” i detta prospekt. Eftersom användningen av blockkedjeteknik inom fondförvaltningsbranschen fortfarande befinner sig i ett tidigt skede uppmanas andelsägarna att noggrant läsa avsnitten om ”Användning av blockkedjeteknik”, ”Riskbeskrivningar” och ”Risker med tokeniserade andelar” i detta prospekt.

Policyer för andelsklasser

UTFÄRDANDE OCH ÄGARSKAP

Registrerade andelar För närvarande emitterar vi endast andelar i registrerad form, vilket innebär att ägarens namn registreras i SICAV-fondens andelsägarregister. Du kan registrera dina andelar i flera ägares namn (upp till fyra), men kan bara använda en registrerad adress. Varje ägare av ett gemensamt konto får agera individuellt på kontot, utom när det gäller rösträtt.

Andelscertifikat Vi utfärdar inte tryckta aktiecertifikat som dokumenterar dina registrerade aktier.

Investera via en finansiell mellanhand jämfört med direkt i SICAV-fonden Om du investerar via en enhet som innehar dina andelar i eget namn (ett konto hos en finansiell mellanhand) har denna enhet laglig rätt att utöva vissa rättigheter som är förknippade med dina andelar, såsom rösträtt. I så fall kan du endast utöva dina investerarrättigheter till fullo direkt mot SICAV-fonden (särskilt rätten att delta vid bolagsstämmor) om du är registrerad själv och i eget namn i SICAV-fondens andelsägarregister. Om du investerar i SICAV-fonden via ett konto hos en finansiell mellanhand kan din rätt till gottgörelse vid fel/bristande efterlevnad av investeringsregler som gäller en delfond även påverkas och endast utövas indirekt. Om du vill behålla alla andelsägarrättigheter kan du investera direkt i SICAV-fonden. Tänk på att i vissa jurisdiktioner kan ett konto hos en finansiell mellanhand vara det enda tillgängliga alternativet.

POLICY FÖR UTDELNING

Utdelande andelar Dessa andelar kommer dela ut hela eller delar av den nettoavkastningen som berörd delfond erhåller och kan även dela ut realiserade och orealiserade kapitalvinster och kapital. När en utdelning betalas ut, minskas substansvärdet för den aktuella klassen med utdelningsbeloppet.

Andelar med ändelsen (D) eller Dist men ingen annan utdelningsrelaterad ändelse deklarerar en årlig utdelning efter beslut av styrelsen. Dessa delfonder sätter inte upp belopp för utdelningsmål.

Ytterligare utdelning kan tillkännages enligt styrelsens beslut.
För mer information om utdelningskalender och mål, gå till amundi.com och/eller amundietf.com

Utdelning på utdelande andelar betalas ut enligt de bankkontouppgifter som vi har registrerat för ditt konto. För varje andel

betalas utdelningen ut i andelsklassens valuta eller i en annan valuta som har valts av styrelsen.

Du kan begära att din utdelning konverteras till en annan valuta. Om valutan är en valuta som delfonden använder debiteras vanligtvis ingen avgift för valutakonvertering. I andra fall debiteras du vanligen tillämpliga kostnader för valutakonvertering. Kontakta överföringsombudet för villkor och avgifter och för att konfigurera tjänsten (se avsnittet ”SICAV”).

Utdelningsbelopp som inte begärts kommer att återföras till delfonden efter fem år. Utdelningar sker endast med andelar som ägs vid avstämningsdagen.

Ingen delfond betalar ut utdelning om fondens tillgångar understiger det lägsta kapitalkravet, eller om en utdelning skulle innebära att så blir fallet.
Tillväxtandelsklasser I tillväxtandelarna räknas nettoinvesteringsintäkterna in i andelskursen. Dessa andelsklasser ger således vanligtvis inte någon utdelning.

ANDRA POLICYER

Med undantag för de andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF” kan en delfond emittera delar av andelar. Delar av andelar tilldelas proportionerlig andel av alla utdelningar, återinvesteringar och behållning efter likvidation.
Andelar ger inte någon företrädes- eller förköpsrätt. Ingen delfond är skyldig att ge befintliga andelsägare några särskilda rättigheter eller villkor för att köpa nya andelar.

Förvärv, byte, inlösen och överlåtelse av aktier

Instruktionerna i detta avsnitt är i allmänhet avsedda för finansiella förmedlare och för investerare som bedriver verksamhet direkt med SICAV-fonden. Om du investerar via en finansiell rådgivare eller annan förmedlare, kan du använda dessa instruktioner, men i allmänhet rekommenderar vi att du lägger alla dina ordrar via din förmedlare om det inte finns anledning att inte göra det.

PÅ PRIMÄRMARKNADEN

Primärmarknaden är den marknad på vilken andelar emitteras av SICAV-fonden och/eller löses in av SICAV-fonden enligt de villkor som anges nedan och i aktuell delfondsbeskrivning (”**primärmarknaden**”).

Primärmarknaden för andelar/delfonder som är betecknade ”UCITS ETF” är i huvudsak relevant för de auktoriserade deltagarna i dessa ETF:er (de ”**auktoriserade deltagarna**”).

Investeringsförvaltaren har ingått avtal med de auktoriserade deltagarna och fastställer de villkor enligt vilka de auktoriserade deltagarna kan teckna och lösa in andelar.

Primärmarknaden avseende andelar som inte är betecknade ”UCITS ETF” är i huvudsak relevant för investerare som anges i avsnittet INVESTERA I DELFONDER – ANDELSKLASSER – BASANDELSKLASSERS BETECKNINGAR.

INFORMATION SOM GÄLLER FÖR ALLA TRANSAKTIONER UTOM ÖVERLÅTELSER OCH TRANSAKTIONER PÅ SEKUNDÄRMARKNADEN

Göra begäranden för andelsklasser som inte är betecknade ”UCITS ETF”

Begäran om placering:
Du kan när som helst lägga en order om att köpa, byta eller lösa in (sälja tillbaka till SICAV-fonden) andelar via godkända elektroniska medel eller via fax eller brevledes till en distributör eller överföringsombudet (se avsnittet ”SICAV-fonden”). Ordrar via fax är till sin natur föremål för överföringsfel, och vi kan inte vara ansvariga för faxordrar som inte når oss, inte är läsbara eller som blir förvanskade i överföringen.

När du lägger en order måste du inkludera all nödvändig identifierande information och instruktioner om delfonden, andelsklass, konto och storlek och typ av transaktion (inköp, byte eller inlösen).
Du kan ange värdet på en begäran som ett valutabelopp eller ett andelsbelopp.
Notera att order som kommer fram vid en tidpunkt då transaktioner i delfondsandelar avbryts kommer annulleras.

Tidsfristen för ansökningar som tas emot på en transaktionsdag definieras i varje delfond.

För varje transaktion skickas ett bekräftelsemeddelande till den registrerade kontoinnehavaren.

Göra begäranden för andelsklasser som är betecknade ”UCITS ETF”

Utöver det ovanstående kan en auktoriserad deltagare skicka in en handelsbegäran om att teckna eller lösa in andelar i en delfond via en elektronisk plattform för att göra order online. I båda fallen måste den auktoriserade deltagaren skicka in ett handelsformulär.

Användningen av den elektroniska plattformen är föremål för föregående samtycke från förvaltningsbolaget eller, i förekommande fall, investeringsförvaltaren och måste följa tillämplig lagstiftning.

Tecknings- och inlösenorder som görs elektroniskt kan omfattas av en särskild tidsfrist för transaktioner.

Alla ansökningar sker på den auktoriserade deltagarens egen risk. Handelsformulär och elektroniska handelsbegäranden ska, när de har godkänts (utom enligt vad som fastställs av förvaltningsbolaget eller, i förekommande fall, investeringsförvaltaren), vara oåterkalleliga.

SICAV-fonden, Amundi, förvaltningsbolaget, investeringsförvaltaren, registratorn och överföringsombudet ansvarar inte för eventuella förluster som uppstår vid överföring av handelsformulär eller för eventuella förluster som uppstår vid överföring av en handelsbegäran via det elektroniska ordersystemet.

Handel in natura och kontant

SICAV-fonden kan acceptera teckning och betala inlösen antingen in natura eller kontant (eller en kombination av både kontanter och in natura).

För auktoriserade deltagare kan lägsta initiala teckningsbelopp och lägsta inlösenbelopp vara högre än de belopp som anges i varje delfonds beskrivning.
För att undvika tvivel gäller lägsta initiala teckningsbelopp och lägsta inlösenbelopp för andra investerare än auktoriserade deltagare enligt vad som anges i varje delfonds beskrivning.

1. **Handel in natura**

Investeringsförvaltaren gör portföljsammansättningsfilen för delfonderna tillgänglig som fastställer formen av investeringar och/eller kontantkomponent som ska levereras a) av auktoriserade deltagare vid teckning eller b) av SICAV-fonden vid inlösen, i utbyte mot andelar. Förvaltningsbolagets nuvarande avsikt är att portföljsammansättningsfilen vanligtvis kommer att ange att investeringarna måste vara i form av de relevanta investeringarnas beståndsdelar. Portföljsammansättningsfilen för delfonderna för varje transaktionsdag kommer att finnas tillgänglig på begäran från förvaltningsbolaget eller investeringsförvaltaren och relevant mellanhand.

2. Kontanthandel

SICAV-fonden kan acceptera tecknings- och inlösenbegäranden som består helt av kontanter.

Auktoriserade deltagare som vill göra en kontant inlösen ska meddela SICAV-fonden, registratorn och överföringsombudet skriftligen och ordna med överföringen av sina andelar till SICAV-fondens konto.

Om en enskild ansökan om kontantinlösen tas emot avseende en värderingsdag som representerar mer än 10 % av substansvärdet för en delfond, kan styrelsen be andelsägaren att acceptera betalning helt eller delvis genom en utdelning in natura av portföljens värdepapper i stället för kontanter.

Om en andelsägare som löser in accepterar betalning helt eller delvis genom en utdelning in natura av portföljvärdepapper som innehas av den aktuella delfonden kan SICAV-fonden, men är inte skyldig att, upprätta ett konto utanför SICAV-fondens struktur dit sådana portföljvärdepapper kan överföras.

Andelsägaren står för alla kostnader som rör öppning och underhåll av ett sådant konto. När sådana portföljtillgångar har överförts till kontot värderas kontot och en värderingsrapport erhålls från SICAV-fondens revisor.

Alla kostnader för utarbetandet av en sådan rapport ska bäras av berörda andelsägare eller tredje part om inte styrelsen anser att handeln in natura ligger i SICAV-fondens (eller den berörda delfondens) intresse eller görs för att skydda bolagets (eller den berörda delfondens) intresse.

Kontot kommer att användas för att sälja sådana portföljvärdepapper så att kontanter sedan kan överföras till den inlösande andelsägaren. Investerare som erhåller sådana portföljvärdepapper i stället för kontanter vid inlösen bör observera att de kan ådra sig mäklararvoden och/eller lokala skatter vid försäljning av sådana portföljvärdepapper. Dessutom kan inlösenintäkterna från den inlösande andelsägarens försäljning av andelarna vara större eller mindre än inlösenkursen på grund av marknadsförhållandena och/eller skillnaden mellan de kurser som används för att beräkna substansvärdet och de köpkurser som erhålls vid försäljningen av sådana portföljvärdepapper vid den aktuella avvecklingstiden för inlösen.

3. Riktad kontanthandel

Om en begäran görs av en auktoriserad deltagare för att utföra underliggande värdepappershandel och/eller utländsk valuta på ett specifikt sätt, kommer förvaltningsbolaget att göra rimliga ansträngningar för att uppfylla denna begäran om det är möjligt, men förvaltningsbolaget tar inte ansvar om begäran om utförande inte uppnås på det sätt som begärs av någon anledning.

Om en auktoriserad deltagare skickar in en begäran om kontant teckning eller inlösen för att investeringarna ska handlas med en särskild mäklare, kan förvaltningsbolaget efter eget gottfinnande (men ska inte vara skyldigt att) handla med investeringar med den utsedda mäklaren. Auktoriserade deltagare som vill välja en utsedd mäklare måste, före förvaltningsbolaget om tillämpliga investeringar ska handlas, kontakta relevant portföljhandlarbord hos den utsedda mäklaren för att ordna transaktionen.

Förvaltningsbolaget är inte ansvarigt och ska inte ha något ansvar om utförandet av de underliggande värdepapperen med den utsedda mäklaren och i förlängningen den auktoriserade deltagarens teckning eller inlösen inte genomförs på grund av utelämnande, fel, misslyckad eller försenad handel eller avveckling av den auktoriserade deltagaren eller den utsedda mäklaren.

Om den auktoriserade deltagaren eller den utsedda mäklaren inte uppfyller sina åtaganden eller ändrar villkoren för någon del av den underliggande värdepapperstransaktionen ska de stå för alla förknippade risker och kostnader. Under sådana omständigheter har bolaget och förvaltningsbolaget rätt att göra transaktioner med en annan mäklare och ändra villkoren för den auktoriserade deltagarens teckning eller inlösen för att ta hänsyn till fallissemanget och ändringarna i villkoren.

4. Utebliven leverans

Om en auktoriserad deltagare inte lyckas leverera i) de investeringar och den kontantkomponent som krävs för en teckning in natura eller ii) kontanter för en kontant teckning inom angivna avvecklingstider för delfonderna (finns på bekräftelsen) förbehåller sig förvaltningsbolaget rätten att annullera den aktuella teckningsordern och den auktoriserade deltagaren ska ersätta bolaget och förvaltningsbolaget för eventuella förluster som drabbat bolaget och förvaltningsbolaget till följd av underlåtenhet av den auktoriserade deltagare som är andelsägare att leverera de investeringar och den kontantkomponent eller de kontanter som krävs i tid.

När det ligger i en delfonds intresse kan styrelsen efter eget gottfinnande besluta att inte annullera en teckning när en auktoriserad deltagare inte har levererat de investeringar och den kontantkomponent eller de kontanter som krävs, enligt vad som är tillämpligt, inom de angivna avvecklingstiderna. I detta fall kan SICAV-fonden tillfälligt låna ett belopp som motsvarar teckningen och investera det belopp som lånats i enlighet med investeringsmålet och placeringsinriktningen för den aktuella delfonden. När de investeringar och den kontantkomponent eller de kontanter som krävs, enligt vad som är tillämpligt, har mottagits använder SICAV-fonden detta för att betala tillbaka lånen. Dessutom förbehåller sig SICAV-fonden rätten att debitera den aktuella auktoriserade deltagaren för eventuella räntor eller andra kostnader som SICAV-fonden ådrar sig till följd av lånet.

Om investeringar och kontantkomponent eller kontanter som krävs (enligt vad som är tillämpligt) och som levereras av den auktoriserade deltagaren inte är tillräckliga för att täcka dessa räntor eller andra kostnader, eller om den auktoriserade deltagaren inte kan leverera de investeringar och den kontantkomponent eller de kontanter som krävs (enligt vad som är tillämpligt) så snart som det är praktiskt möjligt, kan förvaltningsbolaget efter eget gottfinnande annullera ordern och den auktoriserade deltagaren ska ersätta SICAV-fonden och förvaltningsbolaget för eventuella i) räntor eller kostnader som de ådragit sig (inklusive men inte begränsat till transaktionskostnader relaterade till portföljjusteringar och eventuella tillämpade räntor i samband med kontantlån) och ii) förluster (inklusive men inte begränsat till förlust av värdet på underliggande tillgångar mellan processer för säkring och avbruten säkring (”marknadsexponering”)) som drabbar SICAV-fonden och förvaltningsbolaget till följd av detta avvecklingsfel.

En begäran om inlösen av en auktoriserad deltagare kommer endast att vara giltig om den auktoriserade deltagaren uppfyller avvecklingsåtagandet att leverera innehav i det erforderliga antalet andelar i den delfonden till administratören till de aktuella avvecklingstiderna (finns på bekräftelsen). Om en auktoriserad deltagare inte levererar de erforderliga andelarna i den aktuella delfonden för inlösen inom angivna avvecklingstider förbehåller sig SICAV-fonden och förvaltningsbolaget rätten (men ska inte vara skyldiga) att behandla detta som en utebliven avveckling av den auktoriserade deltagaren och att annullera den aktuella inlösenordern, och den auktoriserade deltagaren ska ersätta SICAV-fonden och förvaltningsbolaget för eventuella förluster som SICAV-fonden och förvaltningsbolaget drabbas av till följd av den auktoriserade deltagarens underlåtenhet att leverera de nödvändiga andelarna i rätt tid, inklusive (men inte begränsat till) eventuell marknadsexponering och kostnader som delfonden och förvaltningsbolaget ådrar sig.

FÖR ALLA INVESTERARE PÅ PRIMÄRMARKNADEN

Bryttidpunkter och behandlingsschema:

Är fastställt i varje specifik delfondsbeskrivning.

De regler för orderhandläggning som beskrivs i detta prospekt, inklusive de som gäller datum och substansvärde som kommer gälla för utförandet av en order, kommer ha företräde över alla andra skriftliga eller muntliga meddelanden. Ett bekräftelsemeddelande skickas normalt.

Alla ansökningar om att köpa, byta, lösa in eller överföra andelar måste tas emot och godkännas (vilket innebär att de har anlänt till överföringsombudet och anses vara fullständiga och giltiga) före den bryttid som anges för den aktuella delfonden i ”BESKRIVNING AV DELFONDERNA”. Alla beställningar som inte anses vara mottagna före bryttiden behandlas på den aktuella delfondens nästa transaktionsdag. Även den faktiska beräkningen och publiceringen av substansvärdet anges i respektive delfondsbeskrivning.

Olika tidsgränser kan gälla om teckning av andelar görs via en distributör/finansiell mellanhand, men i vilket fall ska den finansiella mellanhanden/distributören se till att teckningsorder på en viss transaktionsdag, enligt definitionen i ”TERMER MED SPECIFIKA BETYDELSER”, tas emot före den bryttidpunkt som anges i ”BESKRIVNING AV DELFONDERNA” för den aktuella delfonden. Ingen distributör/finansiell mellanhand får hålla inne teckningsorder för att personligen dra nytta av en kursändring. Investerare bör notera att de kanske inte kan köpa eller lösa in andelar genom en distributör/finansiell mellanhand på dagar då distributören/den finansiella mellanhanden inte har öppet.

Alla ansökningar om teckning/inlösen kommer att hanteras till ett okänt substansvärde (”terminspris”).

Teckning av andelar kan endast accepteras på grundval av aktuellt prospekt och relevant faktablad. Bolaget kommer att utarbeta en reviderad årsrapport (”**årsrapporten**”) som innehåller reviderade räkenskaper och en oreviderad halvårsrapport (”**halvårsrapporten**”). Efter publiceringen av den första av rapporterna gäller det aktuella prospektet vid det datumet endast om det åtföljs av en sådan årsrapport eller halvårsrapport om sådana har utfärdats senare. Dessa rapporter i den senaste versionen utgör en integrerad del av prospektet.

Prissättning Andelar prissätts utifrån andelsklassens andelsvärde och noteras i valutan för den aktuella andelsklassen. Priset kommer att vara det substansvärde som beräknas på den dag då din beställning behandlas (inte den dag då vi får din beställning). Eftersom detta substansvärde inte beräknas förrän minst en bankdag efter att vi har accepterat din begäran, är det inte möjligt att känna till andelskursen i förväg.

Utspädningsavgift:

En extra tecknings-/inlösenavgift kan tas ut av SICAV-fonden för investerare som tecknar eller löser in UCITS ETF- eller EXF-andelar. Syftet är att ta hänsyn till de sammanlagda kostnaderna för att köpa och/eller sälja underliggande investeringar i samband med sådana teckningar eller inlösen (se avsnittet ”ANDELSKLASSER”).

Satsen för utspädningsavgiften kommer från tid till annan att fastställas av styrelsen för varje delfond för att motsvara den uppskattade mellanskillnaden av sälj- och köpkursen för de tillgångar i vilka delfonden investerar samt beräknad skatt, handelskostnader och relaterade kostnader som kan uppstå för delfonden till följd av köp och/eller försäljning av underliggande investeringar.

Valutakonverteringar:

Vi kan acceptera och göra betalningar i de flesta fritt konvertibla valutorna. Om valutan för din order är en valuta som delfonden godtar, då debiteras vanligtvis ingen avgift för valutakonvertering. I andra fall debiteras du vanligen tillämpliga kostnader för valutakonvertering, och det kan även uppstå en fördröjning med din investering eller mottagandet av inlösenlikviden. Överföringsombudet konverterar valutor till valutakurser som gäller vid tidpunkten för konverteringen.

Kontakta överföringsombudet (avsnittet ”SICAV-fonden”) innan du begär en transaktion i en annan valuta än andelsklassen. I vissa fall kan du bli ombedd att överföra betalningen tidigare än vad som normalt skulle krävas.

Avgifter:

Alla köp, byten eller inlösen kan medföra avgifter avsedda för försäljningsombud. För de maximala avgifter som tas ut av varje grundläggande andelsklass, se avsnittet ”ANDELSKLASSER”. För att ta reda på den faktiska köp-, bytes- eller inlösenavgiften, kontakta din finansiella rådgivare eller ditt överföringsombud (avsnittet ”SICAV-fonden”). Andra parter som är inblandade i transaktionen, t.ex. en bank, en finansiell förmedlande börs eller ett betalningsombud, kan ta ut sina egna avgifter. Vissa transaktioner kan generera skatteförpliktelser. Du ansvarar för alla kostnader och skatter som är kopplade till varje order du lägger.

Ändringar i kontoinformation Du måste omgående informera oss om eventuella ändringar i personuppgifter eller bankinformation. Om du vill ändra det bankkonto som är kopplat till din delfondsinvestering måste du kunna styrka dina handlingar.

Om detta inte görs kan det leda till att en ansökan om inlösen försenas. SICAV-fonden förbehåller sig rätten att kräva gottgörelse eller annan verifiering av äganderätt eller anspråk på äganderätt som kontrasignerats av en bank, börsmäklare eller annan part som är godtagbar för den innan sådana ändringar accepteras.
Om en teckning inte godkänns helt eller delvis betalas teckningsbeloppet eller utestående belopp tillbaka till tecknaren genom post- eller banköverföring på tecknarens risk. Transaktionen avvecklas inom två bankdagar efter den aktuella transaktionsdagen.

Bekräftelse

En bekräftelse skickas till tecknaren (eller det utsedda ombudet i förekommande fall, som begärs av tecknaren) så snart som det är praktiskt möjligt med fullständig information om transaktionen (”**bekräftelsen**”). Tecknare bör alltid kontrollera bekräftelsen för att säkerställa att transaktionen har registrerats korrekt.

Andra tecknare än auktoriserade deltagare får ett personligt kontonummer (”**kontonumret**”) vid godkännande av den inledande teckningen, och detta tillsammans med andelsägarens personuppgifter är bevis på deras identitet för SICAV-fonden.
Kontonumret ska användas av andelsägaren vid alla framtida kontakter med SICAV-fonden och registratorn och överföringsombudet.

FÖRVÄRV AV AKTIER

Se även ”Information som gäller för alla transaktioner utom överlåtelser och transaktioner på sekundärmarknaden”.

Innan din första investering ska du lämna in en ifylld ansökningsblankett tillsammans med de handlingar som behövs för att öppna kontot, däribland alla obligatoriska uppgifter gällande skatt och bekämpning av penningtvätt, till en distributör eller överföringsombud (se avsnittet ”SICAV-fonden”). Om du gör din begäran via fax måste du följa upp genom att skicka en papperskopia till överföringsombudet (se avsnittet ”SICAV-fonden”). När ett konto har öppnats kan du lägga ytterligare ordrar via fax eller brev.

Köp av tokeniserade andelar

När ansökningsformuläret har godkänts ska registrerings- och överlåtelseombudet skapa en plånbok åt andelsägaren. Du kommer att tilldelas en unik blockkedjeadress som är kopplad till din plånbok. Detta gör det möjligt för dig att övervaka andelssaldot via en särskild webbapplikation eller genom offentligt tillgängliga blockkedjeutforskare. Endast plånböcker som skapats och/eller godkänts av registrerings- och överlåtelseombudet får förvärva, lösa in och inneha tokeniserade andelar. Mer information om hur plånboken fungerar finns i avsnittet om, ”Användning av blockkedjor”.

Notera att alla ordrar som anländer innan ditt konto är helt godkänt och upprättat, kommer normalt att hållas väntande tills kontot är operativt.

Om vi inte erhåller full betalning för dina andelar inom den tid som anges ovan för avveckling, kan vi lösa in dina andelar, annullera deras emission och lämna tillbaka betalningen till dig, med avdrag för eventuella investeringsförluster och oförutsedda utgifter som uppstår vid annullering/inlösen av de emitterade andelarna (enligt närmare beskrivning i avsnittet ”Utebliven leverans” för auktoriserade deltagare).

För optimal behandling av investeringar, skicka pengar via banköverföring i samma valuta som de andelar du vill köpa.

Fleråriga investeringsplaner:

Vissa distributörer, med godkännande av styrelsen, kan erbjuda planer där en investerare förbinder sig att investera ett visst belopp i en eller flera delfonder under en angiven period. I utbyte kan investeraren få en lägre köpavgift än vad som skulle ha tillämpats om samma investeringar gjorts utanför planen.
Den distributör som driver planen kan ta ut planrelaterade avgifter. Det totala beloppet för dessa avgifter som investerare betalar under hela tiden de är registrerade i planen får dock inte vara mer än en tredjedel av det belopp de investerar under sitt första år i planen.

Villkoren för varje plan beskrivs i en broschyr (som ska åtföljas av eller ange hur prospektet ska erhållas). För att ta reda på vilka distributörer som för närvarande erbjuder planer, och i vilka jurisdiktioner, kontakta SICAV-fonden (se avsnittet ”SICAV-fonden”).

Enligt en flerårig investeringsplan har du fortfarande alla rättigheter gällande inlösen av dina andelar som du normalt skulle ha.

BYTE AV AKTIER

Se även ”Information som gäller för alla transaktioner utom överlåtelser och transaktioner på sekundärmarknaden”.

Med undantag för UCITS ETF-andelsklasser kan du byta (konvertera) andelar i de flesta delfonder och klasser till andelar inom samma delfonder och klasser eller andelar i andra delfonder och klasser. För att säkerställa att ett byte är tillåtet, se avsnittet ”Andelsklasser” eller kontakta en distributör eller ett överföringsombud (se avsnittet ”SICAV-fonden”).

När det gäller UCITS ETF-andelsklasser kan du bara byta mellan två UCITS ETF-andelsklasser från samma delfond.

Följande villkor gäller alla byten: Du måste uppfylla alla godtagbarhetskrav för den andelsklass som du begär att byta till. Du kan endast byta till en delfond och andelsklass som är tillgänglig i ditt bosättningsland. Bytet får inte bryta mot några restriktioner för någon av de berörda delfonderna (så som angivet i ”BESKRIVNING AV DELFONDERNA”).

Alla andelsbyten behandlas baserat på "värde-för-värde", vilket innebär att vi utgår från de aktuella investeringarnas substansvärden (och om förekommande eventuella valutaväxlingsavgifter) vid tidpunkten för bytet.

När du lagt en order om att byta andelar, kan du endast dra tillbaka den om det uppstår ett handelsstopp för berörd delfond.

Bytet i den distribuerade databastekniken (DLT) utförs genom att andelarna i investerarens plånbok präglas eller bränns.

INLÖSEN AV AKTIER

Se även ”Information som gäller för alla transaktioner utom överlåtelser och transaktioner på sekundärmarknaden”.

När du löser in andelar kommer vi att skicka betalningen (i andelens basvaluta) enligt vad som anges i den specifika delfondens beskrivning. För att få din inlösenlikvid konverterad till en annan valuta, kontakta en distributör eller ett överföringsombud innan du gör din förfrågan (se avsnittet ”SICAV-fonden”).

Vi kommer endast att betala inlösenlikviden till den eller de andelsägare som finns i andelsägarregistret Utdelning betalas ut enligt de bankkontouppgifter som vi har registrerat för ditt konto. SICAV-fonden betalar ingen ränta för försenad betalning av inlösenbelopp, om detta orsakas av faktorer som ligger utanför fondbolagets kontroll.

Styrelsen förbehåller sig rätten att fördröja betalningen under ytterligare fem bankdagar, utan upplupen ränta, om marknadsförhållandena är ogynnsamma och det ligger i de återstående andelsägarnas intresse enligt styrelsens rimliga uppfattning.

När du lagt en order om att lösa in andelar, kan du endast dra tillbaka den om det uppstår ett handelsstopp för berörd delfond.

För auktoriserade deltagare:

Avveckling av överföringen av investeringar och/eller kontanta betalningar avseende teckning och inlösen sker inom de bankdagar som anges i den aktuella bekräftelsen (enligt definitionen ovan) efter transaktionsdagen (eller en tidigare tidpunkt som styrelsen kan fastställa). SICAV-fonden förbehåller sig rätten att efter eget gottfinnande kräva att den sökande ersätter SICAV-fonden för eventuella förluster som uppstår till följd av en delfonds underlåtenhet att erhålla betalning inom angiven avvecklingstid.

Oaktat det föregående kan betalning av inlösenintäkterna försenas om det finns några särskilda lokala lagbestämmelser eller vid force majeure som ligger utanför SICAV-fondens kontroll, vilket gör det omöjligt att överföra inlösenintäkterna eller gå vidare med en sådan betalning inom den normala tidsfristen. Denna betalning ska göras så snart som det är praktiskt möjligt därefter, men utan ränta.

En bekräftelse skickas till den auktoriserade deltagaren med uppgifter om de inlösenintäkter som ska betalas så snart som det är praktiskt möjligt efter fastställande av inlösenavgiften för de andelar som löses in. Andelsägare bör kontrollera bekräftelsen för att säkerställa att transaktionen har registrerats korrekt.
Observera att vi inte kommer att betala ut några inlösenintäkter förrän vi har fått all investerardokumentation från dig som vi kan anse vara nödvändig.

När en tokeniserad andel löses in bränns de tokens som är registrerade på blockkedjan, vilket innebär att investeraren får tokenet borttaget från sin plånbok.

ÖVERLÅTELSE AV AKTIER

Som ett alternativ till byte eller inlösen kan du överlåta ägandet av dina andelar till en annan investerare genom överlåtelseombudet (se avsnittet ”SICAV-fonden”).

Observera att alla överlåtelser omfattas av eventuella godtagbarhetskrav och begränsningar som kan gälla. Till exempel kan institutionella andelar inte överlåtas till icke-institutionella investerare, och inga andelar av något slag kan överlåtas till en amerikansk investerare. Om en överlåtelse till en ej berättigad ägare sker, kommer styrelsen antingen att ogiltigförklara överlåtelsen, kräva en ny överlåtelse till en godtagbar ägare eller tvångslikvidera andelarna.

En överlåtelse av en tokeniserad andel innebär att de tokens som är registrerade på blockkedjan överförs, vilket betyder att överlåtaren får sina tokens överförda från sin plånbok till förvärvarens plånbok.

SEKUNDÄRMARKNAD FÖR UCITS ETF-ANDELSKLASSER

SICAV-fondens avsikt är att för var och en av de andelar betecknade som ”UCITS ETF”, bedriva handel under hela dagen med alla andelar på minst en reglerad marknad eller multilateralt handelssystem med minst en marknadsgarant som vidtar

åtgärder för att säkerställa att börsvärdet för andelsklassen inte väsentligt skiljer sig från dess NAV eller iNAV.

Det är påtänkt att göra en ansökan om att börsnotera de andelar betecknade som UCITS ETF på en eller flera börser.

Styrelsen kan när som helst besluta att notera andelarna på flera börser i enlighet med en ansökan från SICAV-fonden. Det är tänkt att ansökan kommer lämnas in om att börsnotera vissa andelsklasser på Luxemburgbörsen, Frankfurtbörsen och/eller någon annan börs. En fullständig förteckning över dessa börser där andelarna kan köpas och säljas kan erhållas från SICAV-fondens säte.

Den huvudsakliga marknadsgaranten för alla andelar betecknade som UCITS ETF definieras i den specifika delfondens beskrivning. För att undvika tvivel kan andra marknadsgaranter ibland utses av SICAV-fonden för en eller flera börser på vilka vissa andelsklasser är noterade. Den huvudsakliga marknadsgaranten kan när som helst bytas ut av SICAV-fonden. Den huvudsakliga marknadsgaranten som SICAV-fonden utser för varje delfond anges på webbplatsen amundietf.com.

Förfarande för köp och försäljning på sekundärmarknaden
Sekundärmarknad är marknaden på vilken andelarna kan köpas och/eller säljas direkt på börserna.

För alla köp och/eller försäljningar av andelar som görs på sekundärmarknaden krävs inget minimiköp och/eller försäljning utöver det minimum som kan krävas av den relevanta börsen.

SICAV-fonden tar inte direkt ut någon inköps- eller försäljningsavgift i samband med köp eller försäljning av ETF-andelar på någon börs där de är noterade. Marknadsförmedlare tar dock ut förmedlingsavgifter eller andra typer av avgifter. SICAV-fonden erhåller inte dessa avgifter.

Andelar i de delfonder som köpts på sekundärmarknaden kan i allmänhet inte lösas in från SICAV-fonden. Investerare måste köpa och sälja andelar på sekundärmarknaden med hjälp av en förmedlare (t.ex. en aktiemäklare) och kan ådra sig avgifter för detta. Dessutom kan investerare bli tvungna att betala mer än det aktuella substansvärdet när de köper andelar och erhålla mindre än det aktuella substansvärdet när de säljer dem.

Om sekundärmarknaden, som inte baseras på en indexlikviditetshändelse, stoppas, får SICAV-fonden tillåta andelsägare att lösa in sina andelar på primärmarknaden till en kurs baserad på tillämpligt substansvärde per andel. Dock gäller förutsättningen att substansvärde per andel inte i sig stoppas enligt gällande bestämmelser och/eller prospekt och/eller bolagsordningen.

Stoppet på sekundärmarknaden innebär att varje situation där det är omöjligt för andelsägarna att sälja sina andelar på alla börser där den aktuella andelen är noterad under minst tre bankdagar sedan (i) stoppet av noteringen av marknadsoperatören eller (ii) möjligheten att handla som samtliga andelsägare iakttar på den aktuella börsen och som grundar sig på antingen:

- Väsentlig variation av börsvärdet för de noterade andelarna i delfonden jämfört med dess indikativa substansvärde (NAV).
- Bristen på auktoriserade deltagare, eller de auktoriserade deltagarnas oförmåga att fullgöra sitt åtagande att bedriva sin verksamhet genom en permanent närvaro på marknaden, vilket gör det omöjligt att handla med andelarna på platsen där andelarna är upptagna för handel.
- Indexlikviditetshändelsen avser alla marknadsstörningar och/eller eventuell likviditetsemission som påverkar delar av eller alla delar av indexet, vilket leder till att marknadsvärderingen stoppas.

Under sådana exceptionella fall då primärmarknaden är öppen kommer förvaltningsbolaget att lägga upp på webbplatserna amundi.com och amundietf.com det förfarande som ska följas av investerare som vill lösa in sina andelar på primärmarknaden.

Förvaltningsbolaget kommer även att tillhandahålla nämnda förfarande till aktiemarknadsoperatören där delfondens andelar är noterade. Beroende på vilka arrangemang som finns mellan den berörda förmedlaren och de andra värdepappersföretag som är inblandade i inlösenkedjan, kan ytterligare begränsningar, förseningar eller förmedlingsavgifter tillkomma, och andelsägarna kommer uppmanas att kontakta sin relevanta förmedlare för att få ytterligare information om dessa eventuella begränsningar och/eller avgifter (varvid sådana förmedlingsavgifter inte kommer gå till förvaltningsbolaget).

Inlösenorder som behandlas under dessa omständigheter i enlighet med villkoren i inlösenförfarandet kommer inte omfattas av de potentiellt tillämpliga lägsta inlösentrösklarna, och inlösenkostnaderna bör endast bestå i inlösenavgiften enligt beskrivningen i varje delfondsbeskrivning och i avsnittet ”INVESTERA I DELFONDER – ANDELSKLASSER – ANDELSKLASSERNAS BETECKNING”

Hur vi beräknar substansvärde

Tidpunkt och formel:

Vi beräknar substansvärdet för alla andelsklasser i alla delfonder vid slutet av varje bankdag. Den faktiska beräkningen av substansvärdet sker den bankdag som följer på transaktionsdagen.

Dessutom kan tekniska substansvärden (”**T-NAV**”) beräknas och offentliggöras för alla kalenderdagar (utom lördagar och söndagar) som varken är bankdag eller transaktionsdag. Dessa T-NAV är endast indikativa och kommer inte att ligga till grund för inköp, byte, inlösen och/eller överföring av andelar.

Varje substansvärde anges i andelsklassens utvalda valuta (och även i andra valutor för vissa andelsklasser) och beräknas med minst två decimaler utom vad gäller penningmarknadsdelfonder, för vilka substansvärdet avrundas högst till närmaste baspunkt. Alla substansvärden vars kurssättning omfattar valutaomräkning av ett underliggande substansvärde beräknas till gällande växelkurs vid den tidpunkt då substansvärdet beräknas.

Följande formel gäller när vi beräknar substansvärdet för delfondens andelsklasser:

$$\frac{\text{(tillgångar - skulder)}}{\text{antal utestående andelar}} = \text{substansvärde}$$

Lämpliga åtgärder vidtas för att beräkna de kostnader och avgifter som påförs varje delfond och andelsklass samt upplupna intäkter från investeringar. I bolagsordningen finner du mer specifik information om de beräkningsformler vi använder.

Swingprissättning:

Swingprissättning är en mekanism som syftar till att skydda befintliga andelsägare från värdeutspädning som orsakas av handelskostnader som uppkommit till följd av teckning och inlösen i en delfond under en viss dag.

Mekanismen tillämpas på delfondsnivå för alla andelsklasser*, och är inte avsedd att behandla specifika omständigheter för varje enskild investerare. Delfonderna tillämpar full swingprissättning, vilket innebär att swingprissättning tillämpas under en viss bankdag när det finns teckning och (eller) inlösenaktivitet i de specifika delfonderna.

Delfondens substansvärde kommer justeras för att minska utspädningseffekten för delfonden. Dessa justeringar försöker återspegla de faktiska kurserna på de underliggande

transaktionerna, baserat på uppskattade handelspreadar, kostnader och andra marknads- och handelsöverväganden, i enlighet med den interna process som finns på plats hos förvaltningsbolaget.

Substansvärdet justeras uppåt vid ett nettoinflöde till delfonden och nedåt vid ett nettoutflöde till delfonden (”**full swing pricing**”). Alla sådana justeringar tillämpas på all teckning och inlösen under denna transaktionsdag.

För en given bankdag är justeringen normalt inte större än 2 % av substansvärdet, men styrelsen kan höja denna gräns vid behov för att skydda andelsägarnas intressen.
I ett sådant fall kommer ett meddelande till investerare att publiceras på den särskilda webbplatsen.

Styrelsen får under exceptionella omständigheter delegera till en av de ledande befattningshavare i bolaget beslut om att tillämpa en procentsats som är större än 2 %.

Styrelsen kan besluta att tillämpa delvisa swingpriser i stället för full swingprissättning. Delvisa swingpriser innebär att substansvärdet endast justeras om nettoteckningar eller inlösen överstiger ett visst tröskelvärde. I sådana fall kommer ett meddelande till andelsägarna att publiceras på den särskilda webbplatsen: www.amundi.lu/amundi-index-solutions.

Om en delvis swingprissättning tillämpas gäller en sådan justering lika för all teckning och inlösen denna transaktionsdag, när nettoinflöden/utflöden överskrider tröskelvärdet. På samma sätt kan styrelsen när som helst besluta att tillfälligt upphäva delvis swingprissättning. Delfonden/delfonderna som omfattas av delvis swingprissättning återgår därefter till full swingprissättning. Andelsägare rekommenderas att kontrollera webbplatsen för att veta om en delfond för närvarande tillämpar full eller delvis swingprissättning. Förvaltningsbolaget fattar och granskar regelbundet de operativa besluten om swingprissättning i enlighet med sin interna process.

Swingprissättning gäller för alla delfonders andelar utom:
UCITS ETF-andelar, och
EXF-andelar

(Se även avsnittet ”ANDELSKLASSER” och ”UTSPÄDNINGSAVGIFT” i avsnittet ”FÖRVÄRV, BYTE, INLÖSEN OCH ÖVERLÅTELSE AV ANDELAR”.)

Tillgångsvärderingar Värdet på varje delfonds tillgångar fastställs i regel enligt följande:

- **Kontanta medel eller insättningar, skulder eller fordringar, förutbetalda kostnader, kontantutdelning eller upplupen men ännu inte erhållen ränta.** Värderat till fullt värde, minus eventuell lämplig rabatt som vi kan tillämpa baserat på våra bedömningar av eventuella omständigheter som gör full betalning osannolik.
- **Överlåtbara värdepapper, penningmarknadsinstrument och derivat som är noterade eller omsätts på någon börs eller handlas på någon annan reglerad marknad.** Allmänt värderat till den sista tillgängliga marknadskursen på den aktuella bankdagen.
- **Icke-noterade värdepapper, eller noterade värdepapper för vilka kursen fastställts enligt ovan angivna metoder som inte är representativa för verkligt marknadsvärde.** Värderas i god tro med en väl avvägd uppskattning av försäljningspriset.
- **Derivat som inte är noterade på någon officiell börs eller handlas över disk.** Värderas dagligen på ett tillförlitligt och verifierbart sätt, i enlighet med marknadspraxis.
- **Andelar i UCITS- eller UCI-fonder.** Värderas till det senaste substansvärdet som rapporterats av UCITS-/UCI-fonden tillgängligt vid tidpunkten för delfondens beräkning av substansvärdet.
- **Swappar.** Värderas till aktuellt nettovärde av sina kassaflöden.
- **Valutor.** Värderas till marknadens valutakurser (gäller för valutor som innehas som tillgångar och när värden hos värdepapper i andra valutor omvandlas till delfondens basvaluta).

För alla tillgångar kan styrelsen välja en annan värderingsmetod om den anser att metoden kan resultera i en mer rättvisande värdering.

Handel som görs i en delfonds portfölj återspeglas på den bankdag den görs i den mån det är praktiskt möjligt.
I bolagsordningen finner du fullständig information om hur vi värderar investeringar.

iNAV SICAV-fonden kan efter eget gottfinnande göra, eller utse andra personer att göra det på fondens vägnar, ett intradags-substansvärde (”**iNAV**”) tillgängligt varje arbetsdag för en eller flera andelar/delfonder betecknade som UCITS ETF. Om SICAV-fonden eller dess ombud gör sådan information tillgänglig på en bankdag, beräknas iNAV baserat på tillgänglig information under handelsdagen, eller någon del av handelsdagen. Normalt baseras det på det aktuella värdet av tillgångarna/exponeringarna justerat med relevant valutakurs, i förekommande fall, för den andel/delfond eller det finansiella index som gäller på denna bankdag, och därtill eventuellt kontantbelopp i andelen/delfonden per föregående bankdag.

SICAV-fonden eller dess ombud kommer tillhandahålla ett iNAV om detta krävs av någon relevant börs.

Ett iNAV är inte, och bör inte anses vara eller åberopas som att vara, värdet på en andel eller kursen till vilken andelar kan tecknas eller lösas in eller köpas eller säljas på någon relevant börs. I synnerhet är det möjligt att varje iNAV som föreskrivs för varje andel/delfond när värdepappren i det berörda finansiella indexet inte aktivt handlas under tiden för publiceringen av ett sådant iNAV inte återspeglar andelens verkliga värde, och kan vara vilseledande och är då inte tillförlitligt.

Investerare bör vara medvetna om att beräkningen och rapporteringen av ett iNAV kan återspegla tidsfördröjningar i mottagandet av kurserna på de relevanta värdepapperen i jämförelse med andra beräknade värden baserade på samma värdepapper, bland annat det berörda finansiella indexet eller iNAV för andra ETF som bygger på samma finansiella index.

Investerare som är intresserade av att köpa eller sälja aktier på en relevant börs bör för sitt investeringsbeslut inte enbart förlita sig på ett iNAV som görs tillgängligt, utan investerare bör även beakta annan marknadsinformation och relevanta ekonomiska samt andra faktorer (inbegripet, i förekommande fall, information om det berörda finansiella indexet, relevanta värdepapper och finansiella instrument baserade på det finansiella indexet som motsvarar berörd andel/delfond).

Skatter

SKATTER SOM BETALAS FRÅN DELFONDENS TILLGÅNGAR

Taxe d’abonnement:

SICAV-fonden är vanligtvis föremål för en teckningsskatt (”**taxe d’abonnement**”). För indexerade delfonder (med noterade andelar) undantas SICAV-fonden från ”taxe d'abonnement” enligt artikel 175 (e) i 2010 års lag.

En sådan skatt beräknas och betalas kvartalsvis, på den relevanta delfondens sammanlagda nettotillgångar enligt värderingen den sista dagen i varje kvartal.

Även om ovanstående skatteinformation är korrekt enligt styrelsens kännedom är det möjligt att en skattemyndighet kan införa nya skatter (inklusive retroaktiva skatter) eller att de luxemburgska skattemyndigheterna till exempel kan besluta

att varje klass som för närvarande omfattas av 0,01 % taxe d'abonnement bör omklassificeras och omfattas av 0,05 % skatt.

Det senare fallet skulle kunna inträffa för en institutionell andelsklass i en delfond under en period då en investerare som inte har rätt att inneha institutionella andelar konstaterades ha innehaft sådana andelar.

SICAV-fonden omfattas för närvarande inte av andra luxemburgska skatter på intäkter eller kapitalvinster. När det gäller aktivt förvaltade delfonder är SICAV-fonden befriad från teckningsskatt (”taxe d’abonnement”) så länge de berörda delfonderna är noterade. Om det finns flera enheter eller delfonder inom en noterad fondföretagsfond gäller undantaget endast den enhet eller delfond som kvalificerar sig som en börshandlad fond.

Även om ovanstående skatteinformation är korrekt enligt styrelsens kännedom, är det möjligt att en skattemyndighet kan införa nya skatter (inklusive retroaktiva skatter).

Indisk kapitalvinstskatt gäller för indiska värdepapper. Beräkningar av kapitalvinstskatt som uppstår till följd av portföljtransaktioner som rör inlösen hanteras via utspädningsmekanismen (teckningsavgift/swingprissättning) och kan resultera i ytterligare spridning, vilket kan minska nettointäkterna som tas emot för inlösen. Kapitalvinstskatt som uppstår till följd av portföljtransaktioner som inte rör inlösen (t.ex. ombalansering) bärs av respektive fond.

SKATTER SOM DU ÄR ANSVARAR FÖR

Skattebetalare i Luxemburg:
Andelsägare som Luxemburg anser vara bosatta eller på annat sätt har fast driftställe där, för närvarande eller tidigare, kan bli föremål för skatter i Luxemburg.

Skattebetalare i andra länder:
Andelsägare som inte är skattebetalare i Luxemburg är inte föremål för någon skatt på kapitalvinst, inkomst, gåvor, egendom, arv eller källskatt eller andra skatter i Luxemburg, med de sällsynta undantagen för vissa tidigare bosatta i Luxemburg och investerare som äger mer än 10 % av SICAV-fondens totala värde. En investering i en delfond kan dock ha skatteföljder i alla jurisdiktioner som anser att du är skatteskyldig där.

EU:s direktiv om källskatt på sparande

Vi registrerar automatiskt alla delfondskonton i funktionen för informationsutbyte för EU:s direktiv om skatt på sparande (EUSD). Som ett resultat av detta rapporteras information om utdelningar och inlösen i vissa delfonder till myndigheterna i Luxemburg, som i sin tur kommer att dela den med skattemyndigheterna i den EU-medlemsstat där andelsägaren är bosatt.

FATCA USA:s lag om skatt på utländskt konto (Foreign Account Tax Compliance Act, FATCA) medför en källskatt på 30 % på vissa betalningar till utländska enheter som har sitt ursprung i USA, såvida inte ett undantag gäller. Från och med den 1 januari 2017 kan andelsägare som inte lämnar all FATCA-relaterad information som efterfrågas, eller som vi tror är amerikanska investerare, bli föremål för denna källskatt på hela eller en del av inlösen eller utdelningar som betalas av delfonden.

Från och med samma datum kan vi förbjuda försäljning eller ägande av andelar som involverar icke-deltagande FFI (NPFFI) eller någon annan investerare som vi anser vara föremål för källskatt, För att undvika eventuella problem med ”Foreign Passthru payment”-mekanismen och skyldigheten att dra av källskatt.

Amundi Luxembourg och SICAV-fonden betraktas var och en som ”Reporting FFI Model 1” enligt FATCA, och var och en avser att följa ”Model I Intergovernmental Agreement” mellan Luxemburg och USA (IGA). Varken SICAV-fonden eller någon delfond förväntar sig att bli föremål för någon FATCA källskatt.

FATCA kräver att SICAV-fonden och delfonderna samlar in viss kontoinformation (inklusive ägaruppgifter, innehav och utdelningsinformation) om vissa amerikanska investerare, USA-kontrollerade investerare och icke-amerikanska investerare som inte följer gällande FATCA-regler eller inte tillhandahåller all nödvändig information enligt IGA. I detta avseende samtycker varje andelsägare i ansökningsformuläret till att tillhandahålla nödvändig information på begäran från SICAV-fonden, en delfond eller dess ombud.

Enligt IGA måste denna information rapporteras till de luxemburgska skattemyndigheterna, som i sin tur kan dela den med den amerikanska skattemyndigheten (”IRS”) eller andra skattemyndigheter.
FATCA är relativt nytt och genomförandet håller fortfarande på att utvecklas. Även om ovanstående information sammanfattar styrelsens nuvarande förståelse, kan denna förståelse vara felaktig, eller hur FATCA genomförs kan ändras på ett sätt som skulle göra vissa eller alla investerare i delfonderna föremål för en källskatt på 30 %.

Gemensam rapporteringsstandard

Enligt CRS-lag kommer SICAV-fonden sannolikt att behandlas som ett finansiellt institut för rapportering från Luxemburg. Som sådant kommer SICAV-fonden från och med den 30 juni 2017 åläggas att årligen rapportera till skattemyndigheterna i Luxemburg personlig och finansiell information om identifiering och innehav av samt betalningar till vissa investerare och kontrollerande personer från vissa icke-finansiella enheter som själva är rapporteringsskyldiga personer.
Vissa transaktioner som utförs av rapporteringsskyldiga personer kommer rapporteras till skattemyndigheterna i Luxemburg genom utfärdande av kontobesked, som kommer att utgöra en grund för den årliga rapporteringen till dessa myndigheter.

Alla andelsägare som inte uppfyller SICAV-fondens begäran om information eller handlingar kan bli föremål för sanktioner som införs mot SICAV-fonden till följd av att andelsägaren inte tillhandahåller sådan information.

Rättigheter vi förbehåller oss

Vi förbehåller oss rätten att göra något av följande när som helst:

- **Avvisa eller annullera en begäran om att teckna/lösa in andelar,** oavsett om det gäller en inledande eller ytterligare investering och oavsett orsak. Vi kan avvisa hela begäran eller en del av den.

- **Neka din investering om vi inte får all dokumentation** som vi anser nödvändig för att öppna ditt konto. Utan att det påverkar andra specifika regler (se ”Kampen mot penningtvätt och finansiering av terrorism”) betalar vi tillbaka pengarna för din investering utan ränta.

- **Avvisande av teckning/inlösen av andelar som är betecknade ”UCITS ETF”**: SICAV-fonden kan även efter eget gottfinnande (men ska inte vara skyldig att) helt eller delvis avvisa eller annullera teckning av andelar före emissionen av andelar till en auktoriserad deltagare om en insolvenshändelse inträffar för deltagaren och/eller minimera bolagets exponering mot deltagarens insolvenshändelse.

- **Justeringar av teckning/inlösen av andelar som är betecknade ”UCITS ETF”**: SICAV-fonden har även rätt att avgöra om den endast ska acceptera inlösen från en auktoriserad deltagare in natura eller kontant (eller en kombination av både kontanter och in natura) från fall till fall: i) vid meddelande till den aktuella auktoriserade deltagaren när en insolvenshändelse inträffar för deltagaren eller om SICAV-fonden rimligen anser att deltagaren utgör en kreditrisk eller ii) i alla andra fall med deltagarens samtycke (där så är tillämpligt).

– **Inlösningsbegäranden behandlas endast när betalningen ska göras till den auktoriserade deltagarens registrerade konto.** Dessutom kan SICAV-fonden införa sådana begränsningar som den anser nödvändiga för att säkerställa att inga andelar förvärvas av auktoriserade deltagare som inte längre uppfyller avsnittet ”Kampen mot penningtvätt och finansiering av terrorism”.

– SICAV-fonden kan även efter eget gottfinnande fastställa att det under vissa omständigheter är till nackdel för befintliga andelsägare att acceptera en ansökan om andelar kontant eller in natura (eller en kombination av både kontanter och in natura) som representerar mer än 5 % av en delfonds substansvärde. I sådana fall kan styrelsen skjuta upp ansökan och, i samråd med den aktuella auktoriserade deltagaren, kräva att en sådan deltagare skjuter upp den föreslagna ansökan under en överenskommen tidsperiod. Den auktoriserade deltagaren ansvarar för eventuella kostnader eller rimliga utgifter som uppstår i samband med förvärvet av sådana andelar.

– **Lösa in dina andelar och skicka behållningen till dig eller byta ditt innehav till en annan klass om du inte längre uppfyller kriterierna för den andelsklass som du innehar.** Vi meddelar dig 30 kalenderdagar i förväg innan vi gör det för att ge dig tid att byta till en annan klass eller lösa in andelarna.

– **Begära bevis på rätten att inneha andelar eller tvinga en icke kvalificerad andelsägare att ge upp ägarskapet.** Om vi anser att andelar helt eller delvis innehas av en icke kvalificerad ägare eller att omständigheterna kring ägarskapet kan leda till att SICAV beskattas i andra jurisdiktioner än Luxemburg kan vi lösa in andelarna utan ägarens samtycke. Vi kan välja att begära viss information från ägaren för att fastställa att den är kvalificerad, men vi kan ändå när som helst tillämpa tvångsinlösen. SICAV kan inte hållas ansvarig för vinster eller förluster i samband med sådan inlösen.

– **Tillfälligt stoppa beräkningen av substansvärden eller transaktioner med en delfonds andelar** i något av följande fall:

– de huvudsakliga börser eller marknader som förknippas med en betydande andel av delfondens investeringar är stängda under en tid när de vanligen håller öppet eller deras handel är begränsad eller tillfälligt stoppad

– en mottagarfond till vilken delfonden utgör matarfond har tillfälligt stoppat substansvärdesberäkningar eller andelstransaktioner

– styrelsen anser att en nödsituation föreligger som gör det svårt att på ett tillförlitligt sätt värdera eller handla med delfondens tillgångar – detta kan omfatta politiska, militära, ekonomiska, penningpolitiska, skattemässiga eller infrastrukturrelaterade händelser

– portföljtransaktioner hindras eller blockeras av begränsningar för kontantöverföringar eller valutakonvertering, kan inte slutföras till normala växelkurser eller påverkas på annat sätt av betalningsproblem

– det har lämnats meddelande om beslut att fusionera SICAV eller delfonden eller kallelse till en andelsägarstämma där man ska besluta om huruvida delfonden eller SICAV ska likvideras

– någon annan omständighet föreligger som motiverar stoppet för att skydda andelsägarna

– ett tillfälligt stopp kan gälla valfri andelsklass och delfond, eller alla, och alla typer av begäranden (köp, byte, inlösen). Vi kan även vägra att godkänna en begäran om köp, byte eller inlösen av andelar

– under perioder med tillfälliga stopp annulleras alla icke-behandlade teckningsorder och icke-behandlade konverterings-/inlösenorder stoppas tillfälligt såvida inte du återkallar dem

– om behandlingen av din order fördröjs på grund av ett tillfälligt stopp informeras du om stoppet inom 7 dagar från din begäran och om dess upphörande. Om ett tillfälligt stopp pågår ovanligt länge meddelas alla investerare.

– **Begränsa hur många andelar som kan lösas in under en kort tidsperiod.** Ingen delfond är på någon bankdag skyldig att behandla inlösenbegäranden som totalt överstiger antingen 5 % av de utestående andelarna eller 5 % av nettotillgångarna. För att klara dessa gränser kan delfonden minska dessa begäranden proportionellt. Om detta inträffar skjuts icke-genomförda delar upp till nästa arbetsdag. Dagar då den inlösenvolym som ska behandlas är större än inlösenkapaciteten för dagen, enligt reglerna i detta stycke, behandlas alla order som delvis inlösen med samma proportionella andel för varje order. En delfond begränsar endast inlösen när detta är nödvändigt för att förhindra likviditetsbegränsningar som skulle vara skadliga för kvarvarande andelsägare.

– Begäran om inlösen av UCITS ETF-andelsklasser från auktoriserade deltagare som före bryttiden begär att få köpa tillgångarna i denna delfond kan dock (helt eller delvis) uppfyllas, förutsatt att en sådan försäljning inte påverkar de återstående andelsägarnas intressen i denna delfond. De tillgångar som ska säljas till sådana auktoriserade deltagare ska väljas ut av investeringsförvaltaren i enlighet med dess investeringsmål och säljs till det värde som används för att bestämma återköpskursen för de andelar som ska lösas in. Sådan inlösen inkluderas inte i beräkningen av 5 %-gränser.

– **Behandla ovanligt stora köp eller inlösen till en annan kurs än substansvärdet.** För order som vi tror är tillräckligt stora för att köp eller likvideringar av portföljvärdepapper som är nödvändiga för orderbehandling ska kunna påverka den kurs till vilken transaktionen sker kan vi använda faktiska sälj- och köpkurser (för köp respektive likvideringar) vid fastställandet av beloppet för den inlösenbehållning som ska betalas eller det antal andelar i delfonden som köps.

– **Godkänna köporder som inte uppfyller kraven på minsta investering** efter eget gottfinnande.

Värdera till verkligt marknadsvärde:

I alla fall när en delfond har beräknat sitt substansvärde och det därefter sker en väsentlig förändring av de noterade marknadskurserna för delfondens investeringar. Styrelsen kan leda delfonden till att annullera nuvarande substansvärde och emittera ett nytt som återspeglar det verkliga marknadsvärdet för dess innehav. Om några transaktioner behandlades när substansvärdet annullerades kan delfonden behandla dem på nytt till det nya substansvärdet.

Styrelsen kommer endast vidta dessa åtgärder när den anser att de är motiverade mot bakgrund av ovanlig marknadsvolatilitet eller andra omständigheter.

Alla justeringar av verkligt värde kommer tillämpas konsekvent för alla andelsklasser inom en delfond.

Kampen mot penningtvätt och finansiering av terrorism

För att efterleva lagarna i Luxemburg, förordningar, cirkulärbrev osv. som syftar till att förhindra penningtvätt och finansiering av terrorism kan vi eller en distributör eller ombud (särskilt registratorn eller överföringsombudet) kräva vissa typer av kontodokumentation för att kunna säkerställa korrekt identifiering av investerare och verkliga ägare.

Vi eller en distributör eller ombud kan från tid till annan komma att be dig, utöver ansökningsformuläret, om information och verifikationer som vi anser vara nödvändiga enligt vad som fastställs (antingen innan du öppnar ett konto eller när som helst efteråt). För att säkerställa korrekt identifiering i den mening som avses i tillämpliga lagar och förordningar, inklusive information om det verkliga ägandet, bevis på bosättning, penningkälla och förmögenhetsursprung, för att alltid följa gällande lagar och förordningar.

Du kommer också att vara skyldig att regelbundet tillhandahålla uppdaterad dokumentation och i allmänhet måste du alltid se till att varje del av den information och dokumentation som tillhandahålls, särskilt om det verkliga ägandet, hålls uppdaterad. Om du tecknar andelar via en mellanhand och/eller finansiell mellanhand som investerar för din räkning, tillämpas förstärkta due diligence-åtgärder i enlighet med gällande lagar och förordningar för att analysera robustheten för kontrollramen för bekämpning av penningtvätt och finansiering av terrorism hos mellanhanden/den finansiella mellanhanden.

Försening eller underlåtenhet att tillhandahålla den dokumentation som krävs kan leda till att en order fördröjs eller inte utförs, eller att utbetalningar hålls inne. Varken vi eller våra ombud har något ansvar för förseningar eller underlåtenhet att behandla avtal som ett resultat av en investerare som inte tillhandahåller eller endast tillhandahåller ofullständig information och/eller dokumentation.

Det konstateras även att SICAV-fonden, förvaltningsbolaget, registratorn och överföringsombudet ska hållas skadeslösa av den auktoriserade deltagaren mot eventuella förluster som uppstår till följd av att teckningen inte behandlas om information som har begärts av förvaltningsbolaget eller registratorn och överföringsombudet inte har tillhandahållits av den auktoriserade deltagaren.

Vi ska se till att åtgärder för tillbörlig aktsamhet vid investeringar tillämpas på ett riskbaserat tillvägagångssätt i enlighet med gällande lagar och förordningar.

MARKNADSTIMING OCH OTILLBÖRLIGA HANDELSMETODER

Delfonderna är i allmänhet avsedda att vara långsiktiga investeringar och inte instrument för frekvent handel eller för marknadstiming (definieras som kortsiktiga investeringar avsedda att dra nytta av arbitragemöjligheter som kan uppstå genom samspelet mellan marknadsöppningstider och tidpunkten för NAV-beräkningar).

Sådan handel är inte godtagbar eftersom den kan störa portföljförvaltningen och öka delfondens kostnader till nackdel för andra andelsägare. Därför kan vi vidta allvarliga åtgärder för att skydda andelsägarna intressen, bland annat avvisa, stoppa eller avbryta en begäran som vi bedömer som marknadstiming eller otillbörlig handelsmetod. Vi kan även tvångsinlösa din investering om vi anser att du har ingått marknadstiming eller otillbörliga handelsmetoder. Det sker helt på din bekostnad och risk.

För att fastställa i vilken utsträckning vissa transaktioner motiveras av kortsiktig handel eller marknadstiming och därför kan omfattas av policyn att begränsa vissa transaktioner, beaktar SICAV-fonden olika kriterier, inklusive förmedlarens antagande att inbegripa vissa volymer och frekvenser, marknadsnormer, historiska mönster och förmedlares tillgångsnivåer.

SEN HANDEL

Med hjälp av särskilda rutiner säkerställer vi att alla order om köp, byte eller inlösen av andelar som inkommer efter bryttiden för ett visst substansvärde inte behandlas till det substansvärdet.

Sekretess gällande personuppgifter

I enlighet med dataskyddslagen informerar SICAV-fonden, som agerar som personuppgiftsansvarig, andelsägarna (eller om andelsägaren är en juridisk person, informeras andelsägarens kontaktperson och/eller huvudman) om att vissa personuppgifter (”**personuppgifter**”) som lämnas till SICAV-fonden eller dess ombud kan samlas in, registreras, lagras, anpassas, överföras eller på annat sätt behandlas i de ändamål som anges nedan.

Personuppgifter omfattar (i) namn, adress (post och/eller e-post), bankuppgifter, investerat belopp och en andelsägares innehav, (ii) för andelsägare som är företag: namn och adress (post och/eller e-post) för andelsägarens kontaktpersoner, undertecknare och verkliga ägare, och (iii) alla andra personuppgifter som måste behandlas för att uppfylla lagstadgade krav, inklusive skattelagstiftning och utländska lagar.

Personuppgifter som tillhandahålls av andelsägare behandlas för att genomföra transaktioner i SICAV-fondens andelar och för SICAV-fondens legitima intressen.

I synnerhet omfattar legitima intressen (a) att efterleva SICAV-fondens ansvar, reglerande och rättsliga skyldigheter, samt att tillhandahålla bevis på en transaktion eller någon kommersiell kommunikation, (b) bedriva SICAV-fondens verksamhet i enlighet med rimliga marknadsstandarder och (c) behandlingen av personuppgifter i syfte att: (i) upprätthålla andelsägarregistret; (ii) behandla transaktioner i andelar och utbetalning av utdelning; (iii) upprätthålla kontroller avseende sen handel och marknadstiming; (iv) följa tillämpliga regler mot penningtvätt; (v) marknadsföring och kundrelaterade tjänster; (vi) avgiftsadministration, och (vii) skatteidentifiering enligt EU:s sparandedirektiv, OECD:s gemensamma rapporteringsstandard (”**CRS**”) och FATCA.

SICAV-fonden kan, med förbehåll för tillämpliga lagar och förordningar, delegera behandlingen av personuppgifter till andra mottagare av uppgifter, t.ex. förvaltningsbolaget, investeringsförvaltarna, externa förvaltarna, administratören, registratorn och överföringsombudet, förvaringsinstitutet och betalningsombudet, revisorn samt de juridiska rådgivarna för SICAV-fonden och deras tjänsteleverantörer och ombud (”**mottagarna**”).

Mottagarna kan, under eget ansvar, lämna ut personuppgifter till sina ombud och/eller delegerade, endast i syfte att hjälpa mottagarna att tillhandahålla tjänster till SICAV-fonden och/eller för att uppfylla sina egna rättsliga skyldigheter. Mottagare eller deras ombud eller delegerade kan behandla personuppgifter som personuppgiftsbiträden (när de behandlas enligt SICAV-fondens instruktioner), eller som personuppgiftsansvariga (när de behandlar i sina egna syften eller för att fullgöra sina egna rättsliga skyldigheter).

Personuppgifter kan också överföras till tredje part som statliga eller tillsynsmyndigheter, inklusive skattemyndigheter, i enlighet med tillämpliga lagar och förordningar. I synnerhet kan personuppgifter lämnas ut till skattemyndigheterna i Luxemburg, som i sin tur kan, i egenskap av personuppgiftsansvarig, lämna ut samma uppgifter till utländska skattemyndigheter.

Personuppgiftsbiträden kan omfatta alla enheter som tillhör Crédit Agricole eller Société Générale-koncernen (inklusive utanför EU) i syfte att utföra operativa supportuppgifter i samband med transaktioner med andelarna, uppfylla förpliktelser mot penningtvätt och finansiering av terrorism samt undvika investeringsbedrägerier och för att uppfylla CRS:s skyldigheter.

I enlighet med de villkor som fastställs i dataskyddslagen har andelsägare rätt att:

- begära rättelse av sina personuppgifter om de är felaktiga eller ofullständiga
- invända mot behandling av personuppgifter
- begära radering av sina personuppgifter
- begära begränsning av användningen av sina personuppgifter och
- begära överföring av personuppgifter

Andelsägare kan utöva ovanstående rättigheter genom att skriva till SICAV-fonden på följande adress: 5, Allée Scheffer L-2520 Luxemburg, Storhertigdömet Luxemburg

Andelsägarna har även rätt att lämna in ett klagomål till den nationella kommittén för dataskydd ("CNPD") på följande adress: 15, boulevard du Jazz, L-4370 Belvaux, Storhertigdömet Luxemburg eller till en behörig tillsynsmyndighet för dataskydd.

En andelsägare kan, efter eget gottfinnande, vägra att lämna ut sina personuppgifter till SICAV-fonden. I detta fall kan emellertid SICAV-fonden avvisa begäran om teckning av andelar och spärra ett konto för ytterligare transaktioner. Personuppgifter ska inte lagras under längre perioder än de som krävs för ändamålet med behandlingen, med förbehåll för eventuella preskriptionstider som föreskrivs i tillämplig lag.

Information för investerare i vissa länder

ITALIEN

Enligt den fleråriga investeringsplanen som distribueras i Italien, om en planinvestering avslutas före den överenskomna sista dagen, kan du komma att betala mer i köpavgifter än om du hade köpt samma andelar utanför planen.

SICAV-fonden

Verksamhet och organisation

SICAV-FONDENS NAMN

AMUNDI INDEX SOLUTIONS
Säte:
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg
Övrig kontaktinformation:
amundi.com och/eller amundietf.com
Tfn +352 26 86 80 80

Legal struktur
Öppet fondföretag bildat som ett société anonyme och organiserat som ett société d'investissement à capital variable (SICAV).

Rättslig jurisdiktion: Luxemburg
Duration: Obestämd

Bolagsordning:
Daterad den 9 juni 2016 och publicerad på Recueil électronique des sociétés et associations, den 17 juni 2016. Senast ändrad den 31 januari 2020 och publicerad i RESA den 5 mars 2020.

Tillsynsmyndighet:
Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF).
283, route d'Arlon
L-1150 Luxemburg

Registreringsnummer RCS Luxemburg: B 206.810

Räkenskapsår: 1 oktober till 30 september
Kapital: Summan av nettotillgångarna i samtliga delfonder.

Minimikapital (enligt luxemburgsk lag): 1 250 000 euro eller motsvarande i andra valutor.

Andelarnas nominella värde: Ingen

SICAV-fondens rapporteringsvaluta: EUR

Första reviderade årsredovisning
30 september 2017

Första icke-granskade halvårsrapporter
30 september 2016
31 mars 2017

Struktur och tillämplig lag

SICAV-fonden fungerar som en "paraplyfond" under vilken delfonderna skapas och drivs. Varje delfonds tillgångar och skulder är åtskilda från andra delfonders tillgångar (vilket innebär att tredje parts borgenärer endast har tillgång till tillgångarna i den berörda delfonden).

SICAV-fonden klassificeras som ett företag för kollektiva investeringar i överlåtbara värdepapper (UCITS) enligt del 1 i lagen av 2010, och är registrerad på CSSF:s officiella lista över företag för kollektiva investeringar.

Alla rättstvister som rör SICAV-fonden, förvaringsinstitutet eller någon andelsägare kommer prövas av behörig domstol i Luxemburg, även om SICAV-fonden eller förvaringsinstitutet kan väcka talan i en behörig domstol i en annan jurisdiktion när denna jurisdiktions regler kräver det. Möjligheten för en andelsägare att väcka talan mot SICAV-fonden upphör att gälla fem år efter den händelse som talan skulle grundas på (30 år för anspråk som rör rätten till likvidering)

SICAV-fondens styrelse

Mehdi Balafrej (ordförande)
Global Head of Product & Capital Markets – Amundi ETF, Indexing & Smart Beta
Amundi Asset Management
91-93 Boulevard Pasteur 75730 Paris Cedex 15

Pierre Jond (CEO)
Verkställande direktör
Amundi Luxembourg
5, Allée Scheffer, L-2520 Luxemburg

Grégory BERTHIER
Head of Product Engineering – Product Development & Structuring – Amundi ETFs, Indexing & Smart Beta
Amundi Asset Management
91-93, boulevard Pasteur
75015 Paris, Frankrike

Lucien CAYTAN
Oberoende styrelseledamot

Styrelsen ansvarar för den övergripande ledningen och administrationen av SICAV-fonden och har omfattande befogenheter att agera för dess räkning, inklusive

- utse och utöva tillsyn över förvaltningsbolaget
- fastställa placeringsinriktningen och godkänna utnämningen av förvaltare och externa förvaltare
- göra alla bestämningar avseende lansering, ändring, sammanslagning eller avveckling av delfonder och andelsklasser, inklusive frågor som timing, prissättning, avgifter, utdelningspolicy och utbetalning och utdelningsbelopp, likvidation av SICAV-fonden och andra villkor samt bestämma om en delfonds andelar ska noteras på en börs
- fastställa om och var man ska offentliggöra substansvärden och utdelningar för delfonder
- fastställa när och på vilket sätt SICAV-fonden kommer att utöva någon av de rättigheter som förbehålls i detta prospekt eller genom stadga och göra någon tillhörande kommunikation till andelsägare
- säkerställa att förvaltningsbolaget och förvaringsinstitutet är tillräckligt kapitaliserade och att utnämningen är förenlig med lagen av 2010 och alla tillämpliga avtal för SICAV-fonden
- besluta i vilken mån en viss andelsklass ska vara tillgänglig för en specifik investerarkategori eller distributör i en viss jurisdiktion
- godkänna fleråriga investeringsplaner, göra eventuella ändringar i villkoren, avgifterna, den allmänna strukturen och omfattningen av andelsägarval.

Styrelsen ansvarar för informationen i det här prospektet och har vidtagit rimliga åtgärder för att se till att den i sak är korrekt och fullständig.

Styrelseledamöterna utför sitt uppdrag till utgången av ämbetsperioden, eller till dess att deras uppdrag återkallas i enlighet med bolagsordningen. Nya styrelseledamöter utses i enlighet med bolagsordningen och lagstiftningen i Luxemburg.
Styrelsen kan erhålla ersättning för styrelsearbete. Information om sådan ersättning kommer att lämnas ut enligt gällande lag eller förordning.

Tjänsteleverantörer som anlitas av SICAV-fonden

FÖRVARINGSINSTITUT

CACEIS Bank, Luxembourg Branch 5, Allée Scheffer 2520 Luxembourg, Luxemburg – www.caceis.com

Förvaringsinstitutet innehar alla SICAV-fondens tillgångar, inklusive dess kontanter och värdepapper, antingen direkt eller genom andra finansiella institut, såsom korrespondentbanker, dotterbolag eller filialer till förvaringsinstitutet, enligt vad som beskrivs i förvaringsinstitutsavtalet.

Förvaringsinstitutets rättigheter och skyldigheter regleras av det förvaringsinstitutsavtal som ingicks den 9 juni 2016 under en obegränsad tid från och med dagen för dess undertecknande.

Förvaringsinstitutet anförtros förvaringen och/eller, i förekommande fall, bokföring av SICAV-fondens tillgångar på uppdrag av och för andelsägarnas exklusiva intresse. Alla tillgångar som kan hållas i förvar registreras i förvaringsinstitutets böcker i separata konton, som öppnas i SICAV-fondens namn, för varje delfond. Förvaringsinstitutet måste kontrollera SICAV-fondens ägande av sådana tillgångar för varje delfond och se till att SICAV-fondens kassaflöden övervakas korrekt.

Dessutom ansvarar förvaringsinstitutet för att:
- försäljning, emission, återköp, annullering och värdering av andelar sker enligt lag och bolagsordningen
- alla inkomster som SICAV-fonden genererar allokeras på rätt sätt (enligt stadgarna).
- alla pengar skyldiga till SICAV-fonden anländer inom den sedvanliga marknadsperioden
- SICAV-fonden utför styrelsens instruktioner (såvida de inte strider mot lagen eller bolagsordningen)
- andelarnas substansvärde beräknas i enlighet med lagen och bolagsordningen.

Förvaringsinstitutet måste vidta rimlig omsorg för att utöva sina funktioner och är ansvarig för förlust eller stöld av något finansiellt instrument som hålls i förvar. I sådana fall ska förvaringsinstitutet utan onödigt dröjsmål återlämna ett finansiellt instrument av samma typ eller motsvarande belopp till SICAV-fonden, såvida det inte visar sig att förlusten är ett resultat av en extern händelse som ligger utanför dess rimliga kontroll.

I enlighet med Luxemburgs lagstiftning är förvaringsinstitutet skyldigt gentemot SICAV-fonden och dess andelsägare för eventuella förluster som uppstår för förvaringsinstitutet eller till följd av dess underlåtenhet att utföra eller av dess felaktiga utförande av sina uppgifter. Förvaringsinstitutet kan delegera förvaringen av tillgångar till tredjepartsbanker, finansiella institutioner eller clearingföretag utan att det påverkar det ansvar som åvilar förvaringsinstitutet. Listan över sådana delegater eller den potentiella intressekonflikt som kan uppstå från en sådan delegering finns på förvaringsinstitutets webbplats caceis.com, i avsnittet ”veille réglementaire”.

En sådan lista kan uppdateras då och då.

En fullständig förteckning över alla korrespondenter/tredje parts förvaringsinstitut kan erhållas kostnadsfritt och på begäran från förvaringsinstitutet. Aktuell information om förvaringsinstitutets identitet, beskrivning av dess uppgifter och intressekonflikter som kan uppstå samt de förvaringsfunktioner som delegerats av förvaringsinstitutet, och eventuella intressekonflikter som kan uppstå till följd av en sådan delegering, görs också tillgängliga för investerare på förvaringsinstitutets webbplats, som nämnts ovan, och på begäran. Det finns många situationer där en intressekonflikt kan uppstå, särskilt när förvaringsinstitutet delegerar sina förvaringsfunktioner eller när förvaringsinstitutet också utför andra uppgifter för UCITS-fondens räkning, såsom administrationsombud och registratortjänster.

Dessa situationer och intressekonflikter har identifierats av förvaringsinstitutet.

För att skydda UCITS-fonder och dess andelsägares intressen och följa tillämpliga förordningar har en policy och rutiner som syftar till att förhindra situationer med intressekonflikter, och övervaka dem när de uppstår, införts inom förvaringsinstitutet, i syfte att:

- identifiera och analysera potentiella situationer med intressekonflikter
- registrera, hantera och övervaka intressekonflikter antingen via:
  - att förlita sig på de permanenta åtgärder som vidtagits för att ta itu med intressekonflikter, såsom att upprätthålla separata juridiska enheter, segregation av uppgifter, åtskillnad mellan rapporteringslinjer, insiderförteckningar för personalmedlemmar eller
  - genomföra en hantering från fall till fall för att (i) vidta lämpliga förebyggande åtgärder, såsom att upprätta en ny bevakningslista, införa ett nytt vattentät skott, se till att verksamheten utförs på armlängds avstånd och/eller informera berörda andelsägare i UCITS-fonden, eller ii) vägra att utföra den verksamhet som ger upphov till intressekonflikten.

Förvaringsinstitutet har upprättat en funktionell, hierarkisk och/eller avtalsenlig åtskillnad mellan utförandet av sina förvaringsfunktioner för UCITS-fonden och utförandet av andra uppgifter på UCITS-fondens vägnar, särskilt administrationsombudet och registratorn.

Om lagen i ett tredjeland kräver att vissa finansiella instrument hålls i förvar av en lokal enhet och det inte finns några lokala enheter som uppfyller delegationskravet, får förvaringsinstitutet delegera till en lokal enhet. Det förutsätter emellertid att investerarna har informerats i vederbörlig ordning och att instruktioner för att delegera till den berörda lokala enheten har lämnats av eller för SICAV-fonden.

CACEIS och Amundi är medlemmar i Crédit Agricole-koncernen.

REVISOR

Deloitte Audit
20 Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxemburg
Storhertigdömet Luxemburg

Revisorn, en ”reviseur d'entreprise” som utses vid bolagsstämman tillhandahåller en oberoende granskning av SICAV-fondens och samtliga delfonders bokslut en gång om året.

LOKALA OMBUD

SICAV-fonden kan anlita lokala ombud i vissa länder eller på vissa marknader, vars uppgifter omfattar att göra tillämpliga dokument tillgängliga (t.ex. prospekt, faktablad och andelsägarrapporter), på det lokala språket om så krävs. I vissa länder är det obligatoriskt att gå via ett ombud, som kanske inte bara underlättar transaktionerna, utan även innehar andelar i sitt eget namn för investerarnas räkning. Information om lokala ombud i olika länder finns på amundi.com och/eller amundietf.com

Andelsstämmor och röstning

Årsstämman hålls i allmänhet i Luxemburg kl. 11.00 CET den sista fredagen i januari varje år, eller om det inte är en bankdag (enligt definitionen i Luxemburg), därefter nästa bankdag. Styrelsen får i undantagsfall hålla årsstämman utanför Luxemburg. Trots detta ska den första årsstämman hållas den första måndagen i december 2017. Andra andelsstämmor kan hållas på andra platser och tider. Om någon är inplanerad kommer meddelanden att skickas till dig och göras tillgängligt för allmänheten enligt lagar eller förordningar.

Generella beslut som berör alla andelsägare fattas vid ordinarie stämma. De som avser andelsägarnas rättigheter i en specifik delfond, andelsklass eller andelsklasskategori får endast diskuteras vid ett möte med dessa andelsägare.

I kallelsen till mötet anges även eventuellt tillämpligt beslutsmässigt antal. När inget beslutsmässigt antal krävs kommer beslut att fattas om de godkänns med majoritet (antingen två tredjedels majoritet eller enkel majoritet enligt lag) av de andelar som faktiskt röstar i frågan, antingen personligen eller genom ombud.

Varje andel motsvarar en röst i alla frågor som läggs fram vid den ordinarie stämman. Delar av andelar har ingen rösträtt. Ombuden bestämmer rösträtten för alla andelar som de är ägare till. Samma regler gäller vid alla möten i delfonder, andelsklasser eller andelsklasskategorier.

Närmare information om behörighet och röstning vid stämmor finns i den aktuella kallelsen.

Kostnader

SICAV-fonden betalar följande kostnader av andelsägartillgångar: Utgifter som ingår i de avgifter som anges i "beskrivning av delfonderna":

I förvaltningsavgiften
- förvaltningsbolagets och alla andra tjänsteleverantörers avgifter, däribland distributörer.

I den administrativa avgiften
- arvoden till företag såsom revisorer och juridiska rådgivare,
- statliga, tillsyns-, registrerings-, lokala och gränsöverskridande marknadsföringskostnader,
- kostnader för att tillhandahålla andelsägarna information, t.ex. kostnader för att skapa, översätta, trycka och distribuera andelsägarrapporter, prospekt och faktablad,
- extraordinära kostnader, såsom juridisk eller annan expertis som behövs för att försvara aktieägarnas intressen,
- alla andra kostnader i samband med drift och distribution, inklusive kostnader för förvaltningsbolaget, förvaringsinstitutet och alla tjänsteleverantörer under fullgörandet av sina uppdrag för SICAV-fonden.

Utgifter som inte ingår i de avgifter som anges i "beskrivning av delfonderna":

- skatter på tillgångar och inkomster
- standardmäkleri- och bankavgifter som uppstår på affärstransaktioner och värdepappershandel
- eventuella avgifter som styrelsen godkänner att SICAV-fonden ska betala till oberoende styrelseledamöter för sin tjänst i styrelsen (för närvarande betalas inga sådana avgifter)
- eventuella avgifter och kostnader som uppstår för ombud till Amundi Asset Management centralisering av order och stöd till bästa utförande. Vissa av dessa ombud kan vara dotterbolag till Amundi.

Alla kostnader som betalas ur andelsägarnas totala tillgångar återspeglas i beräkningen av andelsvärdet, och de faktiska belopp som betalas anges i årsredovisningen för SICAV-fonden.

Återkommande kostnader kommer först att debiteras löpande intäkter, därefter realiserade kapitalvinster och slutligen kapital. Varje delfond och/eller andelsklass betalar direkt alla kostnader som den ådrar sig och betalar även sin proportionella andel (baserat på substansvärdet) av de kostnader som inte är hänförliga till en specifik delfond eller andelsklass. För varje andelsklass vars valuta skiljer sig från delfondens basvaluta kommer alla kostnader som är förknippade med att upprätthålla den separata andelsklassens valuta (såsom valutasäkring och valutaväxlingskostnader) att belasta den andelsklassen.

Bästa utförande

Varje investeringsförvaltare och extern förvaltare har antagit en policy för bästa utförande för att införa alla rimliga åtgärder för att säkerställa bästa möjliga resultat för SICAV-fonden, när order utförs. Vid fastställandet av vad som utgör det bästa utförandet kommer investeringsförvaltaren och/eller den externa förvaltaren att överväga en rad olika faktorer, såsom kurs, likviditet, hastighet och kostnad, bland annat beroende på dess relativa betydelse baserat på de olika typerna av ordrar eller finansiella instrument.

Transaktioner utförs huvudsakligen via mäklare som väljs ut och övervakas på grundval av kriterierna för policyn om bästa utförande. Motparter som är dotterbolag till Amundi beaktas också. För att uppnå målet om bästa utförande kan investeringsförvaltaren och/eller den externa förvaltaren välja att använda ombud (dotterbolag till Amundi eller inte) för sin orderöverföring och utförande.

Investeringsförvaltaren och den externa förvaltaren får använda mjuka provisionsarrangemang för att göra det möjligt för dem att erhålla varor, tjänster eller andra förmåner (t.ex. analyser) som är fördelaktiga för förvaltningen av SICAV-fonden, i andelsägarnas bästa intresse. Alla transaktioner som genomförs med mjuk provision med avseende på SICAV-fonden omfattas av den grundläggande regeln om bästa utförande och kommer också att offentliggöras i andelsägarrapporterna.

Meddelanden och publikationer

PUBLICERING AV MEDDELANDEN

Meddelande om eventuella händelser som rör din investering i SICAV-fonden eller dess delfonder, såvida inte andra kommunikationsmedier anges i prospektet eller krävs i enlighet med gällande lagar och förordningar, kommer att meddelas via webbplatsen https://www.amundi.lu/retail/Shareholder-Notices/Amundi-Index-Solutions eller eventuella efterträdare till denna.

Du uppmanas därför att regelbundet besöka denna webbplats.

Substansvärde och meddelande om utdelningar för alla befintliga andelsklasser för alla delfonder finns tillgängliga via bolagets säte samt via andra medier enligt styrelsens beslut. Substansvärdet finns även på finesti.com

Information om tidigare resultat finns i faktabladet eller i det relevanta avsnittet "Tidigare resultat" på www.amundietf.com för varje delfond, per andelsklass och i andelsägarrapporterna. Inom fyra månader efter räkenskapsårets slut finns den reviderade årsredovisningen tillgänglig. Ej reviderade halvårsrapporter kan erhållas inom två månader från utgången av den period de omfattar. Räkenskaperna för SICAV-fonden uttrycks i euro och delfondskonton uttrycks i basvalutan för varje delfond.

KOPIOR AV DOKUMENT

Du kan få tillgång till olika dokument om SICAV-fonden online på amundi.com och/eller amundietf.com, hos ett lokalt ombud (om det finns ett sådant i ditt land) eller via bolagets säte, däribland:

- faktablad
- andelsägarrapporter (senaste årsredovisningen och halvårsrapporten)
- meddelanden till andelsägarna
- prospektet
- SICAV-fondens policy för bästa utförande, värderingsavdrag, finansiella garantier, klagomålshantering, hantering av intressekonflikter och rösträtter i samband med portföljvärdepapper
- förvaltningsbolagets ersättningspolicy

Via bolagets säte kan du även få tillgång till kopior av alla ovanstående dokument samt andra relevanta dokument, såsom bolagsordningen, policyn för hantering av intressekonflikter och vissa viktiga avtal mellan SICAV-fonden och förvaltningsbolaget, investeringsförvaltare och tjänsteleverantörer.

Likvidation, omorganisationer eller sammanslagning

LIKVIDATION

Styrelsen kan besluta att likvidera en delfond eller andelsklass om något av följande stämmer:

– värdet på alla tillgångar i delfonden eller andelsklassen understiger eller har inte nått det som enligt styrelsen är det lägsta för en effektiv drift
– likvidationen motiveras av en betydande förändring av den ekonomiska eller politiska situationen som påverkar delfondens eller andelsklassens investeringar
– likvidationen är en del av ett rationaliseringsprojekt (såsom en övergripande anpassning av delfondsutbudet)
– andelsägarnas intressen skulle motivera det.

Om inget av dessa stämmer in, kräver en likvidation av en delfond eller en andelsklass godkännande av andelsägarna i delfonden eller andelsklassen. Godkännande kan ges genom enkel majoritet av de andelar som är närvarande eller företrädda vid ett giltigt möte (inget beslutsmässigt antal krävs).

I allmänhet kan andelsägare i berörd delfond eller andelsklass fortsätta att lösa in eller byta sina andelar, utan inlösen- och bytesavgift fram till likvidationsdagen. De kurser till vilka dessa inlösen och byten genomförs återspeglar eventuella kostnader i samband med likvidationen. Styrelsen kan stoppa eller vägra inlösen och byten om den anser att det ligger i andelsägarnas intresse.

Endast likvidationen av den sista återstående delfonden kommer att leda till likvidation av SICAV-fonden. I ett sådant fall måste SICAV-fonden och alla delfonder upphöra med att emittera nya andelar utom i likvidationssyfte när likvidationen väl har beslutats.

SICAV-fonden kan när som helst lösas upp genom beslut av andelsägare (se bolagsordningen för beslutsmässigt antal och röstningskrav). Om det dessutom fastställs att SICAV-fondens kapital har sjunkit under två tredjedelar av erforderligt minimikapital, måste andelsägare ges möjlighet att rösta om upplösning vid en bolagsstämma inom 40 dagar efter fastställandet. Upplösning kommer ske vid godkännande av en majoritet av de andelar som är närvarande och företrädda vid stämman, eller med 25 % av de andelar som är närvarande och företrädda om SICAV-fondens kapital är under 25 % av minimum (inget beslutsmässigt antal krävs).

Om SICAV-fonden ska likvideras genomförs likvidationen av en eller flera likvidatorer som utsetts av andelsägarstämman. Likvidatorerna genomför likvidationen i enlighet med andelsägarnas intressen och delar ut behållningen (efter avdrag för eventuella likvidationskostnader) till andelsägarna i förhållande till deras innehav.
Belopp som andelsägarna inte gör anspråk på omgående ska deponeras på ett spärrat konto hos ”Caisse de Consignation” i Luxemburg. Andelsägare som inte gör anspråk på sådana belopp inom 30 år förlorar sin rätt till dem enligt luxemburgsk lagstiftning.

SICAV-FONDENS SAMMANSLAGNINGAR

SICAV-fonden kan vara föremål för gränsöverskridande och inhemsk sammanslagning antingen som ett överlåtande fondföretag eller som ett mottagande fondföretag enligt vad som tillåts av 2010 års lag. Styrelsen har befogenhet att godkänna sammanslagningar av andra fondföretag med SICAV-fonden och fastställa ikraftträdandedagar för sådana sammanslagningar. En sammanslagning mellan SICAV-fonden och en annan UCITS-fond måste dock godkännas av en majoritet av de andelar som är närvarande eller företrädda vid en andelsstämma.

Bolagsstämman, som fattar beslut med enkel majoritet av de avgivna rösterna av andelsägare som är närvarande eller företrädda vid stämman utan krav på beslutförhet, ska vara behörig att besluta om sammanslagningens ikraftträdandedag, om SICAV-fonden är det överlåtande fondföretaget och således upphör att existera till följd av sammanslagningen. Sammanslagningens ikraftträdandedag ska registreras genom handling upprättad inför notarius publicus.

Meddelande om sammanslagning ska ges till SICAV-fondens andelsägare. Varje andelsägare ska inom 30 dagar från datumet för meddelandet ges möjlighet att begära antingen återköp av sina andelar kostnadsfritt eller, i förekommande fall, konvertering av sina andelar kostnadsfritt.

SICAV kan även absorbera andra luxemburgska eller utländska företag för kollektiva investeringar som bildats enligt en bolagsform i enlighet med 1915 års lag och andra tillämpliga lagar och förordningar.

Dessutom kan styrelsen besluta att i enlighet med gällande lagar och förordningar fortsätta med absorption av SICAV-fonden, inklusive genom sammanslagning eller genom godtagande av ett bidrag in natura, av ett luxemburgskt eller utländskt företag för kollektiva investeringar (annat än ett fondföretag) som bildats enligt en icke-bolagsform. Vid en sammanslagning beräknas omräkningskursen mellan SICAV-fondens relevanta andelar och andelar i det absorberade företaget för kollektiva investeringar på grundval av det relevanta substansvärdet per andel per absorptionens ikraftträdandedag.

När det gäller bidrag in natura måste en rapport om de bidragna tillgångarna överlämnas till SICAV-fonden av en oberoende revisor (réviseur d'entreprises agréé) om inte annat föreskrivs i tillämplig lagstiftning.

Eventuella kostnader som uppstår i samband med ett bidrag in natura av andra värdepapper eller tillgångar ska bäras av aktuell andelsägare som gör bidraget eller av sådan annan tredje part som SICAV godkänt.

Dessutom ska den art och typ av tillgångar som ska accepteras i ett sådant fall bestämmas av styrelsen och måste överensstämma med SICAV-fondens placeringsinriktning och begränsningar.

SAMMANSLAGNINGAR OCH UPPDELNINGAR AV DELFONDER

Varje delfond kan slås samman, antingen som en överlåtande delfond eller som en mottagande delfond, med en annan delfond eller ett utländskt och/eller ett luxemburgskt fondföretag eller en delfond i detta, i enlighet med definitionerna, förfarandena och villkoren i 2010 års lag. Styrelsen kommer att vara behörig att besluta om en sådan sammanslagning och om dess ikraftträdandedag.

Styrelsen kan även besluta att i enlighet med gällande lagar och förordningar fortsätta med absorption av delfonder, inklusive genom sammanslagning eller genom godtagande av ett bidrag in natura, från en eller flera delfonder i ett annat luxemburgskt eller utländskt företag för kollektiva investeringar (annat än ett fondföretag) oavsett dess rättsliga form.

Vid en sammanslagning beräknas omräkningskursen mellan den aktuella delfondens relevanta andelar och andelar i det absorberade företaget för kollektiva investeringar på grundval av det relevanta substansvärdet per andel per absorptionens ikraftträdandedag. När det gäller bidrag in natura måste en rapport om de bidragna tillgångarna överlämnas till delfonden av en oberoende revisor (réviseur d'entreprises agréé) om inte annat föreskrivs i tillämplig lagstiftning.

Eventuella kostnader som uppstår i samband med ett bidrag in natura av andra värdepapper eller tillgångar ska bäras av aktuell andelsägare som gör bidraget eller av sådan annan tredje part som SICAV godkänt. Dessutom ska den art och typ av tillgångar som ska accepteras i ett sådant fall bestämmas av styrelsen och måste överensstämma med den relevanta delfondens placeringsinriktning och begränsningar.

Varje delfond kan även slås samman som en mottagande delfond med ett annat luxemburgskt och/eller utländskt företag för kollektiva investeringar (annat än ett fondföretag) i enlighet med definitionerna, förfarandena och villkoren i 2010 års lag. Styrelsen kommer att vara behörig att besluta om en sådan sammanslagning och om dess ikraftträdandedag.

I den mån som sammanslagningens ikraftträdandedag kräver godkännande av de andelsägare som berörs av sammanslagningen enligt bestämmelserna i 2010 års lag är bolagsstämman som fattar beslut med enkel majoritet av de avgivna rösterna av andelsägare som är närvarande eller företrädda vid stämman behörig att godkänna ett sådant datum för sammanslagningen. Inga krav på beslutförhet kommer att tillämpas.

I samtliga fall kommer meddelande om sammanslagning att ges till andelsägarna. När godkännande av andelsägarna krävs ska varje andelsägare i aktuella delfonder eller klasser inom en månad från dagen för avsändande ges möjlighet att begära antingen återköp av sina andelar kostnadsfritt eller konvertering av sina andelar kostnadsfritt.

Med förbehåll för eventuellt nödvändigt lagstadgat föregående beslut om att inte invända kan styrelsen besluta om uppdelning av en delfond i två eller flera delfonder och/eller i andra delfonder i enlighet med gällande lagar och förordningar. Styrelsen kommer att vara behörig att besluta om en sådan uppdelning och/eller partiell uppdelning samt om dess ikraftträdandedag.

KONSOLIDERING OCH UPPDELNING AV KLASS(ER)

Med förbehåll för eventuellt nödvändigt lagstadgat föregående beslut om att inte invända kan styrelsen besluta om uppdelning eller konsolidering av en klass i två eller flera klasser av en delfond och/eller andra andelsklasser i enlighet med gällande lagar och förordningar. Styrelsen kommer att vara behörig att besluta om en sådan konsolidering och/eller uppdelning samt om dess ikraftträdandedag.

I samtliga fall ska meddelande om konsolidering eller uppdelning ges till andelsägarna i SICAV-fondens relevanta klass(er). Varje andelsägare ska inom 30 dagar från dagen för meddelandet ges möjlighet att begära antingen återköp av sina andelar kostnadsfritt eller konvertering av sina andelar kostnadsfritt.

FÖRVALTNINGSBOLAGET

Verksamhet och organisation

Förvaltningsbolagets namn
Amundi Luxembourg S.A

Säte och verksamhetsställe
5, Allée Scheffer
L-2520 Luxemburg
Tfn +352 26 86 80 80
Fax +352 26 86 80 99

Juridisk företagsform
Société Anonyme

Stiftat
20 december 1996

Bolagsordning
Den första trädde ikraft den 20 december 1996 och publicerades i Mémorial den 28 januari 1997. Senast ändrad den 1 januari 2018 och publicerad i RESA den 8 januari 2018.

Tillsynsmyndighet
Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF).
283, route d'Arlon
L-1150 Luxemburg

Registreringsnummer
B 57.255

Kapital
17 785 525 EUR

Andra förvaltade FCP
Amundi S.F.
Amundi SIF
Amundi Total Return
CAMCA Lux Finance
Amundi Unicredit Premium Portfolio
Innovative Investment Funds Solutions
Amundi Asia Funds

ANSVAR

Förvaltningsbolaget ansvarar för investeringsförvaltning, administrativa tjänster, marknadsföringstjänster och distributionstjänster. Förvaltningsbolaget fungerar också som hemlandsombud, där den har ansvar för det administrativa arbete som krävs enligt lag och bolagsordningen, samt för att föra bokföring och register över delfonderna och SICAV-fonden. Förvaltningsbolaget lyder under kapital 15 i lagen av 2010.

Förvaltningsbolaget har möjlighet att delegera vissa eller alla sina ansvarsområden till tredje part. Till exempel kan förvaltningsbolaget, så länge det behåller kontroll och tillsyn, utse en eller flera externa förvaltare att hantera den dagliga förvaltningen av delfondens tillgångar, eller investeringsrådgivare när det gäller att tillhandahålla investeringsinformation, rekommendationer och analyser om potentiella eller befintliga placeringar. Förvaltningsbolaget kan också utse en rad tjänsteleverantörer, bland annat de angivna nedan, och utse distributörer, i syfte att marknadsföra och distribuera delfondsandelar i alla jurisdiktioner där andelarna är godkända för försäljning.

AVGIFTER

Förvaltningsbolaget har rätt att erhålla en förvaltningsbolagsavgift enligt vad som anges för varje delfond i dess beskrivning. Denna avgift beräknas utifrån varje delfonds dagliga nettotillgångar och betalas i efterskott i en frekvens som fastställs av förvaltningsbolaget. Förvaltningsbolaget betalar alla investeringsförvaltare, tjänsteleverantörer och distributörer med förvaltningsbolagsavgiften. Förvaltningsbolaget kan besluta att avstå från en del eller hela sin avgift för att minska påverkan på resultatet. Dessa undantag kan tillämpas på alla delfonder eller andelsklasser, under vilken tid som helst och i vilken utsträckning som helst, enligt förvaltningsbolagets beslut.

AVTAL MED FÖRVALTARE OCH ANDRA TJÄNSTELEVERANTÖRER

Investeringsförvaltarna, externa förvaltare och alla andra tjänsteleverantörer har tillsvidareavtal med förvaltningsbolaget om att leverera tjänster. En investeringsförvaltare som begått väsentligt avtalsbrott kan sägas upp omedelbart av SICAV-fonden. I annat fall kan förvaltare och andra tjänsteleverantörer avgå eller ersättas med 90 dagars varsel.

ERSÄTTNINGSPOLICY

Förvaltningsbolaget har utformat och genomfört en ersättningspolicy som är förenlig med och främjar en sund och effektiv riskhantering genom att ha en affärsmodell som till sin natur inte uppmuntrar till för stort risktagande, eftersom denna risk är oförenlig med delfondernas riskprofil. Förvaltningsbolaget har identifierat de anställda vars yrkesverksamhet har en väsentlig inverkan på delfondernas riskprofiler, och kommer se till att dessa medarbetare efterlever ersättningspolicyn.

Ersättningspolicyn innehåller principer för hur fast och rörlig ersättning ska fastställas, anpassas och följas upp utifrån risktagande och långsiktiga resultat.

Sammantaget ska dessa principer vara i linje med förvaltningsbolagets, fondbolagets och andelsägarnas intressen på grundval av faktorer såsom affärsstrategi, mål, värderingar och intressen samt innehålla åtgärder för att undvika intressekonflikter.

Förvaltningsbolaget säkerställer att beräkningen av resultatrelaterad ersättning baseras på SICAV-fondens fleråriga resultat och att betalningen av sådan ersättning fördelas över motsvarande period.

Närmare uppgifter om ledningens nuvarande ersättningspolicy, bland annat en beskrivning av hur ersättning och förmåner beräknas och identiteten på de personer som ansvarar för att tilldela ersättning och förmåner, finns på https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/ Amundi och en papperskopia är tillgänglig för investerare kostnadsfritt på begäran till förvaltningsbolagets säte.

Styrelsen

Styrelseledamöter i förvaltningsbolaget anställda av Amundi

Pierre Jond
Verkställande direktör
Amundi Luxembourg S.A.

David Joseph Harte
Chief Executive Officer
Amundi Ireland Ltd

Bernard De Wit
Vd:ns rådgivare
Amundi Asset Management S.A.S

Céline Boyer-Chammard
Chef för avdelningen för hållbar omvandling och organisation
Amundi Asset Management S.A.S

Styrelseledamöter i förvaltningsbolaget som inte är anställda av Amundi

Claude Kremer
Partner of Arendt & Medernach

Pascal Biville

Oberoende styrelsemedlem

François Marion
Oberoende styrelsemedlem

Ledande befattningshavare

Pierre Jond
Managing Director/Chief Executive Officer
Amundi Luxembourg S.A.

Pierre Bosio
Chief Operating Officer
Amundi Luxembourg S.A.

Loredana Carletti
Head of Amundi Real Assets Luxembourg
Amundi Luxembourg S.A.

Karine Laurencin
Vice verkställande direktör, risk, efterlevnad och juridik
Amundi Luxembourg S.A.

Tjänsteleverantörer som anlitas av förvaltningsbolaget

INVESTERINGSFÖRVALTARE

Amundi Asset Management S.A.S.
Huvudkontor: 91-93 Boulevard Pasteur 75730 Paris Cedex 15

Amundi Japan Ltd
Hibiya Dai Building, 1-2-2, Uchisaiwai-cho, Chiyoda-ku TOKYO #100-0011, Japan

EXTERNA FÖRVALTARE

Amundi Japan Ltd (adress ovan)

Investeringsförvaltaren ansvarar för den löpande förvaltningen av delfonderna.

På begäran av styrelsen kan investeringsförvaltaren ge råd och stöd till styrelsen för att fastställa placeringsinriktningen och för att fastställa relaterade frågor för SICAV-fonden eller för någon delfond.

Investeringsförvaltaren har möjlighet att delegera till externa förvaltare, på egen bekostnad och eget ansvar och med godkännande från styrelsen, förvaltningsbolaget och CSSF, en del av eller alla sina investeringsförvaltnings- och rådgivningsuppgifter.

Till exempel kan förvaltningsbolaget, så länge det behåller kontroll och tillsyn, utse en eller flera externa förvaltare att hantera den dagliga förvaltningen av delfondens tillgångar, eller investeringsrådgivare när det gäller att tillhandahålla investeringsinformation, rekommendationer och analyser om potentiella eller befintliga placeringar.

ADMINISTRATIONSOMBUD

CACEIS Bank, Luxemburgfilialen.
5, Allée Scheffer, L-2520 Luxemburg

Det administrativa ombudet ansvarar för vissa administrativa tjänster som det har delegerats, i synnerhet beräkning av substansvärden, korrekt bokföring för SICAV-fonden, hjälp med utarbetande och inlämnande av finansiella rapporter och alla andra administrativa funktioner som krävs enligt lagstiftningen i Storhertigdömet Luxemburg. Om en eller flera av de uppgifter som anges ovan har delegerats kommer namnet på de utsedda enheterna att anges i föreliggande avsnitt ”Tjänsteleverantörer som anlitas av förvaltningsbolaget”.

REGISTRATOR, ÖVERFÖRINGS- OCH BETALNINGSOMBUD

CACEIS Bank, Luxemburgfilialen.
5, Allée Scheffer, L-2520 Luxemburg

Delöverföringsombud

CACEIS Ireland Limited
4th Floor, Georges Quay Plaza, Georges Quay Ireland
Dublin, Ireland

Registratorn och överföringsombudet ansvarar för att föra SICAV-fondens andelsägarregister, behandla förfrågningar om att emittera, köpa, sälja, lösa in, byta eller överlåta andelar i delfonder och tillhandahålla och övervaka utskick av kontoutdrag, rapporter, meddelanden och andra dokument till andelsägarna. Om en eller flera av de uppgifter som anges ovan har delegerats kommer namnet på de utsedda enheterna att anges i föreliggande avsnitt ”Tjänsteleverantörer som anlitas av förvaltningsbolaget”.

I samband med tokenisering är Caceis Bank, Luxembourg Branch även ansvarig för att genomföra transaktionerna på blockkedjan. I funktionen som registrerings- och överlåtelseombud använder Caceis Bank, Luxembourg Branch bland annat DLT-teknik.

BILAGA 1 – ESG-RELATERADE UPPLYSNINGAR

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI CAC 40 ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
549300TC0PVE58KW9N64

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 35,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**



Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).
Delfonden strävar efter att främja följande miljörelaterade och sociala egenskaper:

– 30 % minskning av koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet
– förbättring av ESG-betyget jämfört med moderindexet
– bättre kvot mellan gröna och bruna företag jämfört med moderindexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

ISS ESG-företagsbetyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

ISS ESG-företagsbetyget tillhandahåller relevanta och framåtblickande data och resultatbedömningar för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG). Med förankring i en helhetssyn på väsentlighet bedöms företagen mot en standarduppsättning universella ESG-teman och ytterligare branschspecifika teman. Väsentlighetsmetoden omfattar både väsentliga hållbarhetsrisker och negativa konsekvenser för samhället och miljön. Med utgångspunkt i en övergripande pool med mer än 700 indikatorer tillämpar ISS ESG cirka 100 sociala, miljö- och styrningsrelaterade indikatorer per betygsatt enhet, som täcker teman som personalfrågor, hantering av leverantörskedjan, affärsetik, bolagsstyrning, miljöstyrning, miljöeffektivitet och andra.

Differentierade viktningsscenarier säkerställer att de teman som är mest väsentliga för ett visst affärsområde/bransch beaktas vederbörligen. Förstklassig status (”Prime”) ges till betygsatta enheter som är ledande inom sina respektive branscher och som uppfyller krävande absoluta resultatförväntningar och därmed ses som väl positionerade för att hantera kritiska ESG-risker och dra nytta av möjligheter som erbjuds av omvandling mot hållbar utveckling.

ESG-företagsbetygsramen erkänner att risker och effekter för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning skiljer sig åt mellan olika branscher. Omfattningen av branschspecifika risker och effekter för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning definierar respektive resultatkrav, fördelningen av vikter mellan dessa betygsdimensioner och den förstklassiga tröskeln per sektor. Företag inom sektorer med hög risk och påverkan som olja och gas måste till exempel visa bättre resultat när det gäller sitt totala betyg än företag i lågrisksektorer som fastigheter för att få den förstklassiga ISS ESG-statusen.

Närmare information om ISS ESG-företagsbetyg finns på följande länk:
https://www.issgovernance.com/file/publications/methodology/Corporate-Rating-Methodology.pdf

Närmare bestämt är CAC 40 ESG Index (”indexet”) konstruerat utifrån CAC 40 Index och tillämpar följande filter:

- Företag med aktiva kritiska kontroverser relaterade till FN:s Global Compact som fastställts av ISS får inte tas med i indexet.
- Företag som enligt data från ISS är involverade i kontroversiella vapen, brytning av termiskt kol, koldriven kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte ingå i indexet.

Alla godtagbara företag från moderindexet väljs ut i sammansättningen av indexet. Om poolen med godtagbara företag har färre än 35 beståndsdelar kommer ytterligare företag från investeringsområdet för CAC Large 60 index som uppfyller urvalskriterierna att läggas till i ordning efter högsta fritt omsättningsbart börsvärde tills det totala antalet utvalda företag når 35. Varje värdepappers vikt i indexet bestäms av en optimeringsprocess för att uppfylla nedanstående begränsningar:

- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet
- förbättrat ESG-betyg jämfört med moderindexet
- bättre kvot mellan gröna och bruna företag jämfört med moderindexet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslutens mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[36].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för CAC 40 ESG Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

CAC 40 ESG Index är ett aktieindex baserat på CAC 40 Index som representerar de 40 största aktierna som handlas mest aktivt på Parisbörsen (moderindexet). Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på kriterier för miljö, socialt ansvar eller bolagsstyrning och strävar efter en minsta minskning av koldioxidintensiteten på 30 % i förhållande till moderindexet, ett förbättrat ESG-betyg och en bättre kvot mellan gröna och bruna företag, allt jämfört med moderindexet.

36 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

CAC 40 ESG Index (”indexet”) baseras på CAC 40 Index och tillämpar följande filter:

- Företag med aktiva kritiska kontroverser relaterade till FN:s Global Compact som fastställts av ISS får inte tas med i indexet.
- Företag som enligt data från ISS är involverade i kontroversiella vapen, brytning av termiskt kol, koldriven kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte ingå i indexet.

Alla godtagbara företag från moderindexet väljs ut i sammansättningen av indexet. Om poolen med godtagbara företag har färre än 35 beståndsdelar kommer ytterligare företag från investeringsområdet för CAC Large 60 index som uppfyller urvalskriterierna att läggas till i ordning efter högst fritt omsättningsbart börsvärde tills det totala antalet utvalda företag når 35.

Varje värdepappers vikt i indexet bestäms av en optimeringsprocess för att uppfylla nedanstående begränsningar:

- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet
- förbättrat ESG-betyg jämfört med moderindexet
- bättre kvot mellan gröna och bruna företag jämfört med moderindexet

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att

emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 35,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

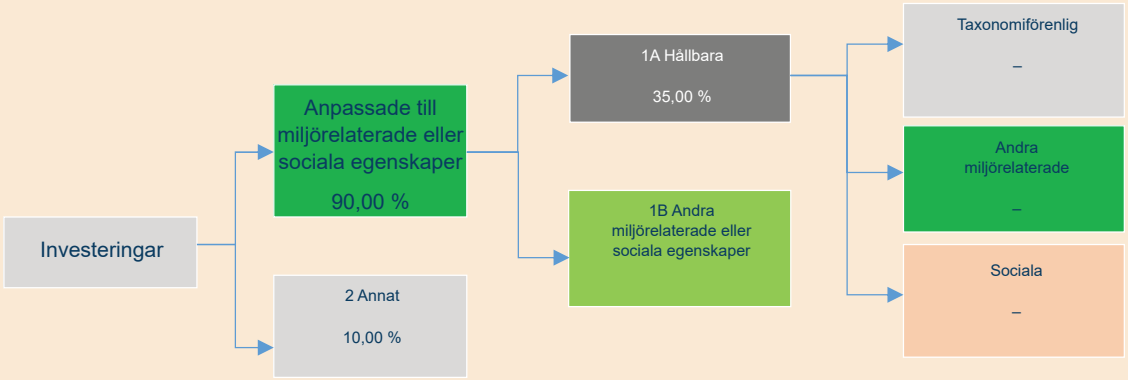
.

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?[37]

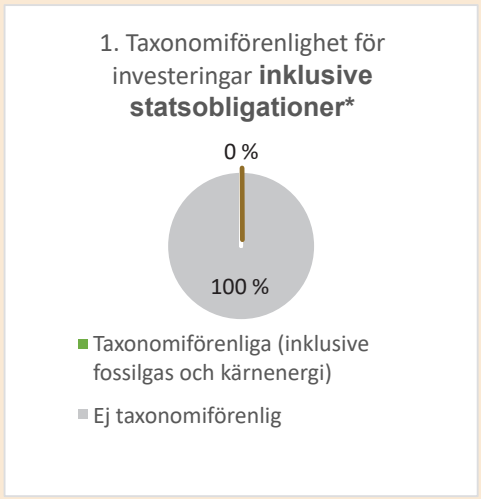
☐ Ja:

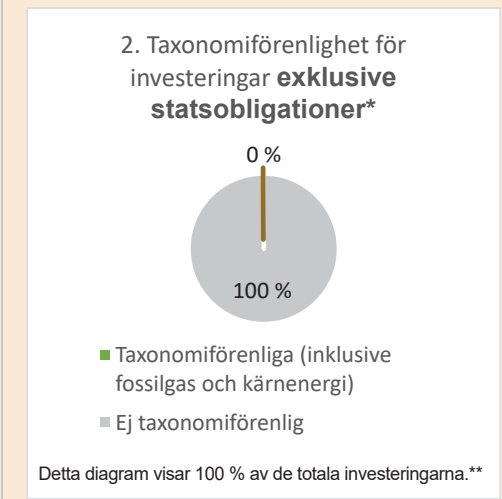
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[37] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 35 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till en minimiandel hållbara investeringar med ett miljömål enligt vad som anges i denna bilaga och ett åtagande att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 35 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till en minimiandel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex som representerar de 40 största aktierna som handlas mest aktivt på Parisbörsen (”moderindexet”). Indexet utesluter företag från moderindexet baserat på kriterier för miljö, socialt ansvar eller bolagsstyrning och strävar efter en minsta minskning av koldioxidintensiteten på 30 % i förhållande till moderindexet, ett förbättrat ESG-betyg och en bättre kvot mellan gröna och bruna företag jämfört med moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://live.euronext.com/en/products/indices



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI EMU Screened

Identifieringskod för juridiska personer:
213800TB2ROJ7LC3AT12

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 35,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:
i. Uteslutning av vissa aktiviteter baserat på ESG-kriterier: tobak, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, utvinning av olja och gas i Arktis, palmolja, energikolreserver och elproduktion från energikol. Dessutom utesluts företag som har identifierats vara involverade i ESG-kontroverser eller inte följer FN:s Global Compact-principer från indexet, baserat på betyg och trösklar definierade av MSCI.

ii. En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.
MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf.

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4
Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet alla värdepapper i moderindexet. Indexets beståndsdelar väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet.

i. Först och främst exkluderas värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt företagsaktivitet som inkluderar kontroversiella vapen, civila skjutvapen, tobak, elproduktion från energikol, energikolreserver och/eller utvinning av olja och gas i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser och tillsammans med företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter.

ii. Dessutom tillämpar MSCI på det kvarvarande investeringsområdet en iterativ process med syfte att nå en minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet. Om minskningen av växthusgaser på 30 % jämfört med moderindexet inte nås tillämpas följande iterativa process:
1. Värdepapperen rangordnas i fallande ordning baserat på växthusgasintensitet.
2. Värdepapperet med högsta växthusgasintensitet utesluts och resulterande index jämförs med moderindexet för att avgöra om en 30 % minskning av växthusgasintensitet har uppnåtts.
3. Om minskningen har uppnåtts behövs inga ytterligare värdepapper.
Om minskningen inte har uppnåtts utesluts ytterligare värdepapper enligt steg 1 och 2 tills minskningen på 30 % har uppnåtts.

De återstående värdepapperen viktas sedan för det justerade fria omsättningsbara börsvärdet.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1. följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2. undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslutens mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis,

vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[38].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

38 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för MSCI EMU Screened Select ex-Thermal Coal Index (”**indexet**”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index (”**moderindexet**”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag inom EMU-området. Indexet utesluter också företaget från moderindexet baserat på ESG-kriterier (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Indexet har som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

baserat urval:

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden är en passivt förvaltad börshandlad fond.
Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Indexets beståndsdelar väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet.

– Först och främst exkluderas värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt företagsaktivitet som inkluderar kontroversiella vapen, civila skjutvapen, tobak, elproduktion från energikol, energikolreserver och/eller utvinning av olja och gas i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser och tillsammans med företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter.

– Dessutom tillämpar MSCI på det kvarvarande investeringsområdet en iterativ process med syfte att nå en minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet. Om minskningen av växthusgaser på 30 % jämfört med moderindexet inte nås tillämpas följande iterativa process:
1. Värdepapperen rangordnas i fallande ordning baserat på växthusgasintensitet.
2. Värdepapperet med högsta växthusgasintensitet utesluts och resulterande index jämförs med moderindexet för att avgöra om en 30 % minskning av växthusgasintensitet har uppnåtts.
3. Om minskningen har uppnåtts behövs inga ytterligare värdepapper.
Om minskningen inte har uppnåtts utesluts ytterligare värdepapper enligt steg 1 och 2 tills minskningen på 30 % har uppnåtts.

De återstående värdepapperen viktas sedan för det justerade fria omsättningsbara börsvärdet.
*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

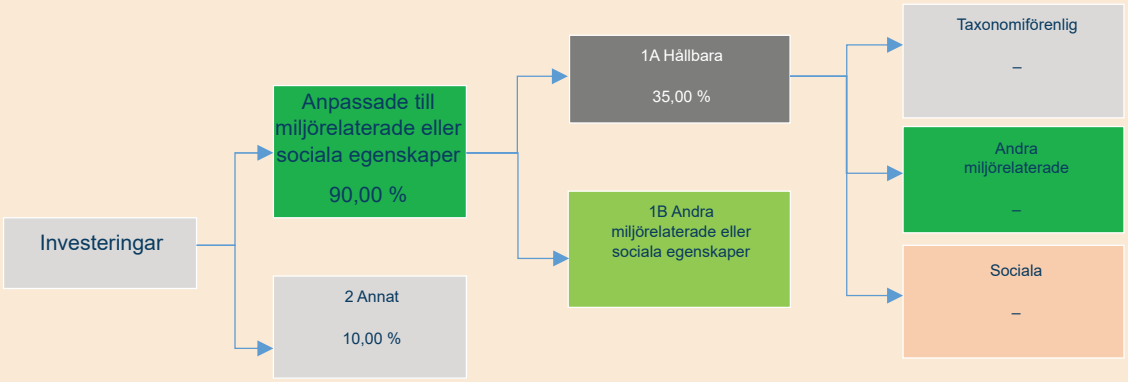
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 35,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

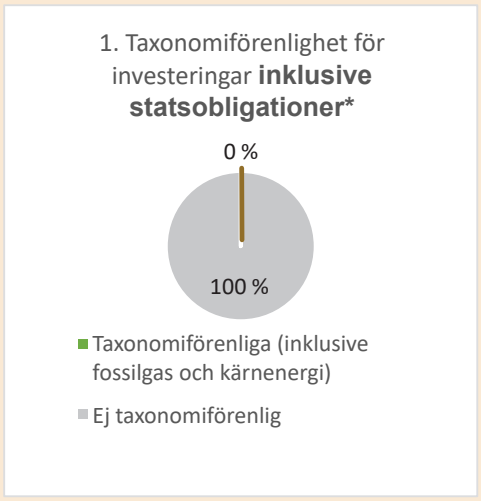
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[39]?***

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[39] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 35 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 35 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index (”**moderindexet**”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag inom EMU-området. Indexet utesluter också företaget från moderindexet baserat på ESG-kriterier (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Indexet har som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på: www.MSCI.com

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi EUR Corporate Bond 0-1Y ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800LLBNM6TDFBXD07

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar IBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index (”indexet”) följande ESG-filter:
Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
- emittenterna måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att vara godtagbara. Emittenter i det godtagbara investeringsområdet utesluts och sedan rangordnas återstående emittenter enligt följande kriterier
- MSCI ESG-betyg (de med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet)
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet)
- Marknadsvärde (de med högre sammanlagt marknadsvärde ges företräde till att bli kvar i indexet)

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än eller lika med 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

Vikten för varje indexkomponent grundas på dess marknadsvärde. Dessutom har varje emittents vikt ett tak för börsvärde på 3 %.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier:

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.

– **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
– **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[40].
– **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Iboxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg emitterade av privata företag (så kallade företagsobligationer) med en återstående löptid på mellan en månad och ett år som tillämpar ytterligare sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index (”indexet”) tillämpar följande ESG-filter:
Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
– emittenterna måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att vara godtagbara. Emittenter i det godtagbara investeringsområdet utesluts och sedan rangordnas återstående emittenter enligt följande kriterier

40 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

- MSCI ESG-betyg (de med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet)
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet)
- Marknadsvärde (de med högre sammanlagt marknadsvärde ges företräde till att bli kvar i indexet)

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än eller lika med 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. Vikten för varje indexkomponent grundas på dess marknadsvärde. Dessutom har varje emittents vikt ett tak för börsvärde på 3 %.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin bygger även på systematiska uteslutningsprinciper (normativa och branschspecifika), vilket beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet utesluter företag som bedriver verksamhet som inte anses vara förenlig med EU-referensvärden för klimatomställning (kolbrytning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

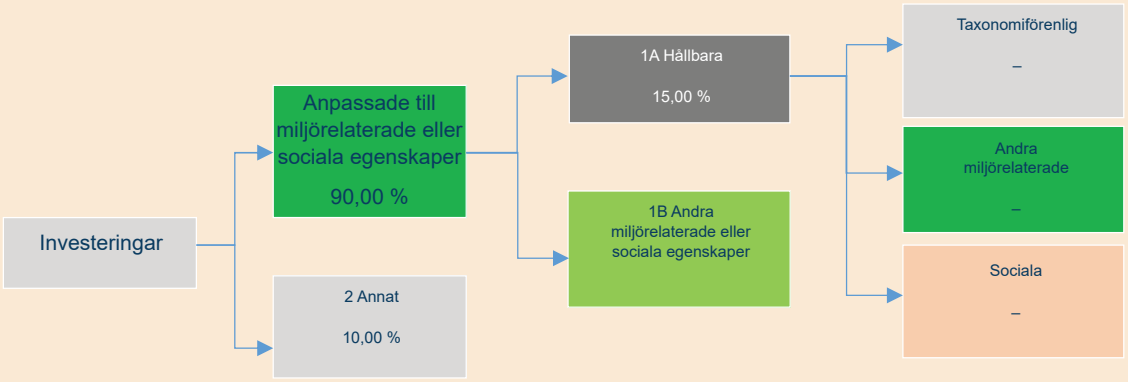
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[41]?

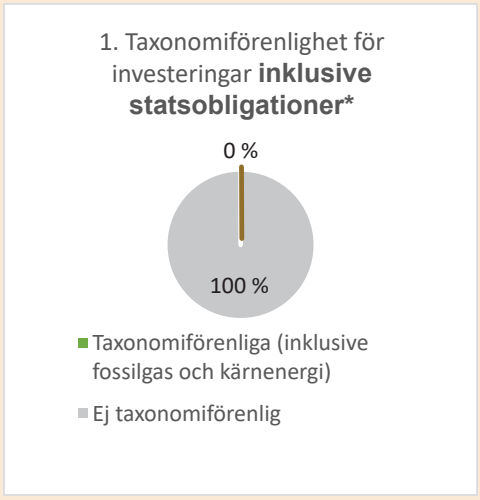
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[41] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Iboxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg emitterade av privata företag (så kallade företagsobligationer) med en återstående löptid på mellan en månad och ett år som tillämpar ytterligare sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.markit.com/Documentation/Product/Iboxx



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
222100VHBKJHMDJL8J52

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: _____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.
MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i euro med en återstående löptid på över 1 år och upp till, men inte inklusive, 5 år och ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner euro). Sedan tillämpas följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval* ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella vapen, civila skjutvapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, fossila bränslen, generering av termiskt kol, oljesand, arktisk olja och arktisk gas utesluts.
3. Företag med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg**, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer godtagbara emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. Om mer än en emittent har samma ESG-betyg och kontroversbetyg och måste tas bort för att nå tröskeln på 20 %, tas alla emittenter med samma ESG-betyg och kontroversbetyg bort.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn). Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak. Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[42].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

42 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate 1-5 Year Select Index (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate 1-5 Year Select Index är ett obligationsindex för företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”moderindexet”) och tillämpar ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i euro med en återstående löptid på över 1 år och upp till, men inte inklusive, 5 år och ett lägsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner euro).

Sedan tillämpas följande filter:
1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval* ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella vapen, civila skjutvapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, fossila bränslen, generering av termiskt kol, oljesand, arktisk olja och arktisk gas utesluts.
3. Företag med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg**, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer godtagbara emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:

– MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
– MSCI ESG-kontroversbetyg (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. Om mer än en emittent har samma ESG-betyg och kontroversbetyg och måste tas bort för att nå tröskeln på 20 %, tas alla emittenter med samma ESG-betyg och kontroversbetyg bort. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

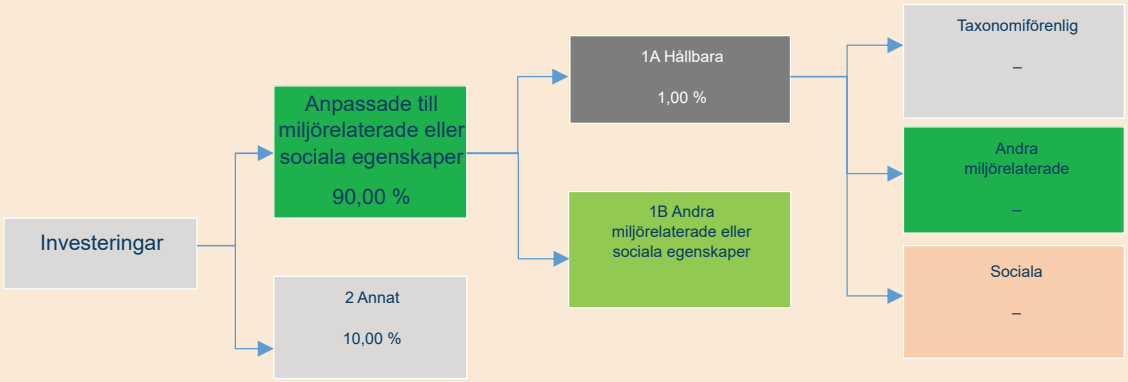
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

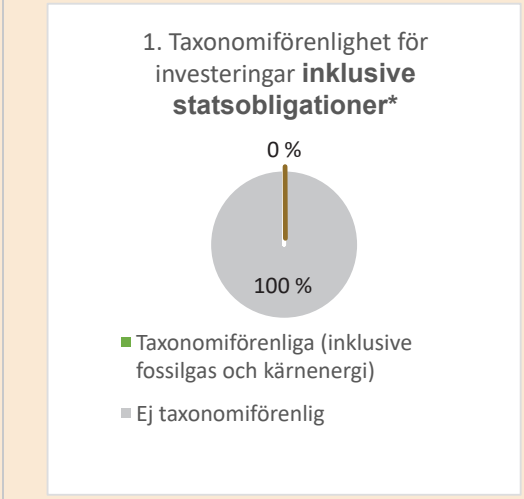
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[43]?***

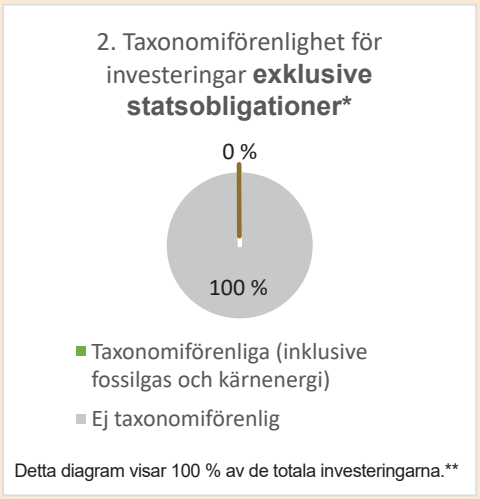
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[43] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Bond Index är ett obligationsindex för företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”moderindexet”) och tillämpar ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
5493006D311IM3Q4K364

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: _____%**
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt väljer iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”indexet”) bort beståndsdelar i det överordnade indexet baserat på följande kriterier:

1. För det första utesluts värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval.
2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.
3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.

Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:

1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)
2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)
3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:
Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[44].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

44 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för investment grade-obligationer denominerade i euro, som är emitterade av emittenter från industriländer som följer reglerna i iBoxx EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”moderindexet”). Indexet tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”indexet”) väljer bort beståndsdelar i moderindexet baserat på följande kriterier:

1. För det första utesluts värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval.

2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.

3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.

Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:

1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)

2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)

3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

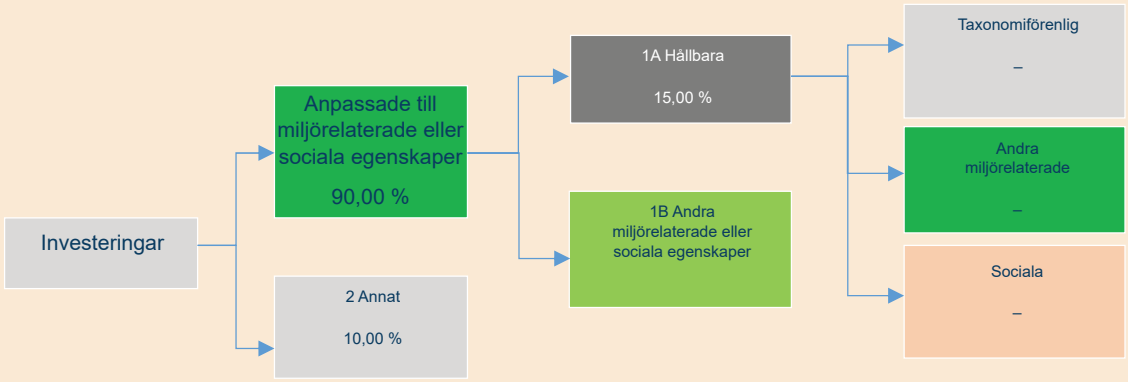
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

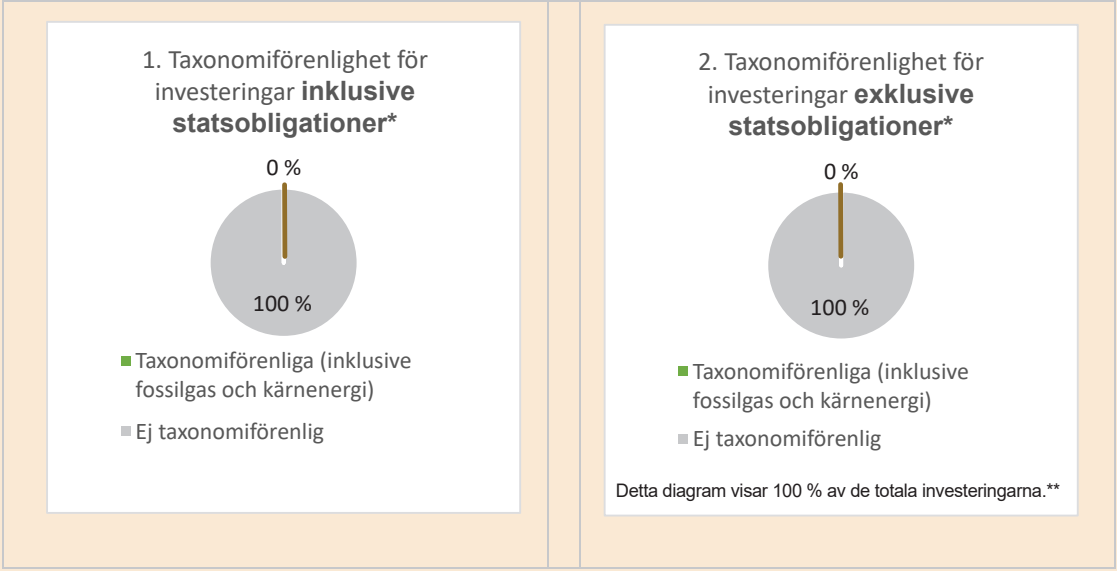
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[45]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[45] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är-verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för investment grade-obligationer denominerade i euro, som är emitterade av emittenter från industriländer som följer reglerna i iBoxx EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”moderindexet”). Indexet tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.markit.com/Documentation/Product/Iboxx

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800ARODHGWDP8MQ71

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen.

Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt är Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate High Yield Select Index (”indexet”) ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med hög avkastning denominerade i euro från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med hög avkastning som är denominerade i euro och emitterade av företag på utvecklade marknader (”investeringsområdet”) väljer Bloomberg Indices obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till:
i) Minsta utestående belopp på obligationsnivå ii) Minsta utestående obligationsbelopp på emittentnivå
iii) Återstående löptid
iv) emittenter som tilldelas ett ESG-betyg (enligt MSCI:s definition). MSCI:s ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från AAA till CCC. MSCI ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg. Tillämpningen av urvalskriterier i) till iv) leder till ett minskat investeringsområde (”det godtagbara investeringsområdet”).
v) Det godtagbara investeringsområdet granskas för att utesluta emittenter som:
– ägnar sig åt verksamheter som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, civila skjutvapen, militära vapen (enligt standardurvalet Bloomberg MSCI SRI), termiskt kol, generering av termiskt kol eller okonventionell olja och gas
– är inblandade i en stor ESG-kontrovers (baserat på MSCI ESG-kontroversbetyg)
– har ett ESG-betyg som är lägre än BBB. Indexet använder en ”best-in-class”-metod, vilket är en metod där investeringar som är ledande eller har bäst resultat väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass.

Genom att använda en sådan best-in-class-metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[46].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

46 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate High Yield Select Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate High Yield Select Index följer företagsobligationer med fast ränta, hög avkastning och ett utestående nominellt belopp på minst 300 miljoner euro. Detta index är baserat på Bloomberg Euro Corporate High Yield Index (”överordnat index”) och använder ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefininerade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate High Yield Select Index (”indexet”) är ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med hög avkastning denominerade i euro från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med hög avkastning som är denominerade i euro och emitterade av företag på utvecklade marknader (”investeringsområdet”) väljer Bloomberg Indices obligationer med kriterier såsom, men inte
Begränsad till:
i) Minsta utestående belopp på obligationsnivå
ii) Minsta utestående obligationsbelopp på emittentnivå
iii) Återstående löptid
iv) emittenter som tilldelas ett ESG-betyg (enligt MSCI:s definition). MSCI ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från AAA till CCC. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg. Tillämpningen av urvalskriterier i) till iv) leder till ett minskat investeringsområde (”det godtagbara investeringsområdet”).
v) Det godtagbara investeringsområdet granskas för att utesluta emittenter som:

– ägnar sig åt verksamheter som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, civila skjutvapen, militära vapen (enligt standardurvalet

Bloomberg MSCI SRI), termiskt kol, generering av termiskt kol eller okonventionell olja och gas
– är inblandade i en stor ESG-kontrovers (baserat på MSCI ESG-kontroversbetyg)
– har ett ESG-betyg som är lägre än BBB. Indexet använder en ”best-in-class”-metod, vilket är en metod där investeringar som är ledande eller har bäst resultat väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass.
Genom att använda en sådan best-in-class-metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).
Produktstrategin bygger även på systematiska uteslutningsprinciper (normativa och branschspecifika), vilket beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.
Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimi minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

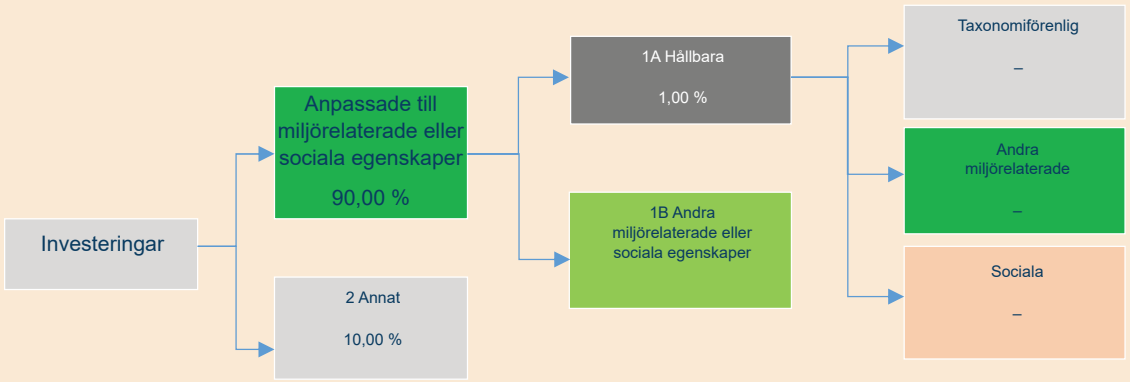
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[47]?***

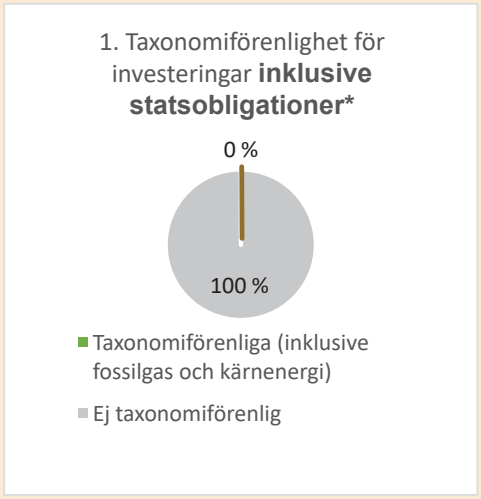
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[47] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Bond Index följer företagsobligationer med fast ränta och hög avkastning och ett minsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner euro. Detta index är baserat på Bloomberg Euro Corporate High Yield Index (”överordnat index”) och använder ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefininerade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
2138001B51SCUCTAZU58

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Indexets godtagbara investeringsområde omfattar alla värdepapper som utgör det överordnade indexet som består av obligationer denominerade i euro och emitterats av offentliga eller privata emittenter med följande godtagbarhetskriterier:
- endast skuldebrev denominerade i euro från emittenter är godtagbara, oberoende risk eller ursprung.
- alla obligationer måste ha ett genomsnittligt kreditbetyg på BB eller B. Det genomsnittliga kreditbetyget beräknas av iBoxx, baserat på de kreditbetyg som tillhandahålls av de tre kreditvärderingsinstituten: Fitch Ratings, Moody's Investors Service eller S&P Global Ratings.
– för att kvalificera sig för indexet måste alla godtagbara obligationer ha en återstående löptid på minst 2 år räknat från respektive ombalanseringsdag till förfallodagen. För obligationer som redan ingår i indexet är den minsta återstående löptiden 1 år vid varje månatlig ombalansering. Alla obligationer måste på ombalanseringsdagen ha en återstående löptid på mellan ett och tre år.
- alla obligationer kräver ett utestående minimibelopp på 300 miljoner euro för att kunna omfattas av indexet.

Därefter utesluter indexet komponenter från moderindexet via en screening baserad på följande kriterier:
1. Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research är inblandade i kontroversiella affärsområden eller verksamheter, som vuxenunderhållning, alkohol, civila skjutvapen, kontroversiella vapen, konventionella vapen, hasardspel, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, kärnvapen, tobak, arktiskt olja, arktisk gas, oljesand, termiskt kol, okonventionell olja och gas är exkluderade.
2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.
3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.
Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:
1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)
2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)
3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld. De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

Se indexmetoden som finns på www.ihsmarkit.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[48].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

48 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates 1–3 TCA Index (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och resultatet för Index. iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates 1–3 TCA Index, ett obligationsindex som representerar obligationer med kreditbetyget BB/B, som är denominerade i euro och emitterade av företagsemittenter och följer reglerna i iBoxx EUR 1–3 TCA-index (”överordnat index”) och tillämpar ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Indexets godtagbara investeringsområde omfattar alla värdepapper som utgör moderindexet, och det består av obligationer denominerade i euro som emitterats av offentliga eller privata emittenter med följande godtagbarhetskriterier:
– endast skuldebrev denominerade i euro från emittenter är godtagbara, oberoende risk eller ursprung.
– alla obligationer måste ha ett genomsnittligt kreditbetyg på BB eller B. Det genomsnittliga kreditbetyget beräknas av iBoxx, baserat på de kreditbetyg som tillhandahålls av de tre kreditvärderingsinstituten: Fitch Ratings, Moody's Investors Service eller S&P Global Ratings.
– för att kvalificera sig för indexet måste alla godtagbara obligationer ha en återstående löptid på minst 2 år räknat från respektive ombalanseringsdag till förfallodagen. För obligationer som redan ingår i indexet är den minsta återstående löptiden 1 år vid varje månatlig ombalansering. Alla obligationer måste på ombalanseringsdagen ha en återstående löptid på mellan ett och tre år.
– alla obligationer kräver ett utestående minimibelopp på 300 miljoner euro för att kunna omfattas av indexet.
Därefter utesluter indexet komponenter från moderindexet via en screening baserad på följande kriterier:
1. Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research är inblandade i kontroversiella affärsområden eller verksamheter, som vuxenunderhållning, alkohol, civila skjutvapen, kontroversiella vapen, konventionella vapen, hasardspel, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, kärnvapen, tobak, arktiskt olja, arktisk gas, oljesand, termiskt kol, okonventionell olja och gas är exkluderade.
2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.
3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts. Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:
1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)
2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)
3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld. De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

Se indexmetoden som finns på www.ihsmarkit.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

* Dessa uteslutningar tillämpas av fonden från den 1 maj 2025.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

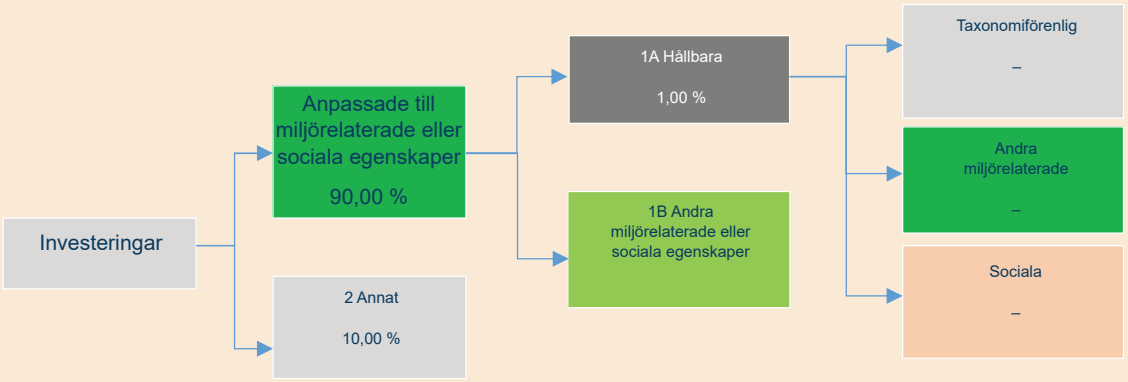
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan något åtagande till ett miljömål eller socialt mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

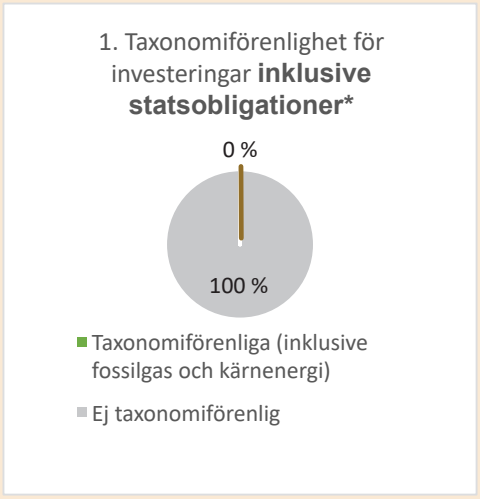
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[49]?***

  ☐ Ja:

  ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

  ☒ Nej

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[49] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med kreditbetyget BB/B emitterade av företagsemittenter som följer reglerna för iBoxx EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index (”moderindexet”) och tillämpar ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800AHCNYOPPST5889

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt är Bloomberg MSCI ESG US Corporate High Yield Select Index (”indexet”) ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med hög avkastning denominerade i US-dollar från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med hög avkastning som är denominerade i US-dollar och emitterade av företag på utvecklade marknader (”investeringsområdet”) väljer Bloomberg Indices obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till:
i) Minsta utestående belopp på obligationsnivå
ii) Minsta utestående obligationsbelopp på emittentnivå
iii) Återstående löptid
iv) emittenter som tilldelas ett ESG-betyg (enligt MSCI:s definition). MSCI:s ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från AAA till CCC. MSCI ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg.

Tillämpningen av urvalskriterierna i) till v) leder till ett begränsat investeringsområde (det ”godtagbara investeringsområdet”).
v) Det godtagbara investeringsområdet granskas för att utesluta emittenter som:
– ägnar sig åt verksamheter som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, civila skjutvapen, militära vapen (enligt standardurvalet Bloomberg MSCI SRI), termiskt kol, generering av termiskt kol eller okonventionell olja och gas
– är inblandade i en stor ESG-kontrovers (baserat på MSCI ESG-kontroversbetyg)
– har ett ESG-betyg som är lägre än BBB.

Indexet använder en ”bäst i klassen”-metod, vilket är en metod där investeringar som är ledande eller har bäst resultat väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Genom att använda en sådan best-in-class-metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier.

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[50].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

[ ] Nej

[50] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI ESG US Corporate High Yield Select Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI ESG US Corporate High Yield Select Index följer företagsobligationer med fast ränta, hög avkastning och ett utestående nominellt belopp på minst 300 miljoner US-dollar. Detta index är baserat på Bloomberg US Corporate High Yield Index (”moderindexet”) och tillämpar ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI ESG US Corporate High Yield Select Index (”indexet”) är ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med hög avkastning denominerade i US-dollar från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med hög avkastning som är denominerade i US-dollar och emitterade av företag på utvecklade marknader (”investeringsområdet”) väljer Bloomberg Indices obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till:
i) Minsta utestående belopp på obligationsnivå
ii) Minsta utestående obligationsbelopp på emittentnivå
iii) Återstående löptid
iv) emittenter som tilldelas ett ESG-betyg (enligt MSCI:s definition). MSCI:s ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från AAA till CCC. MSCI ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg.

Tillämpningen av urvalskriterierna i) till v) leder till ett begränsat investeringsområde (det ”godtagbara investeringsområdet”). v) Det godtagbara investeringsområdet granskas för att utesluta emittenter som:
– ägnar sig åt verksamheter som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, civila skjutvapen, militära vapen (enligt standardurvalet Bloomberg MSCI SRI), termiskt kol, generering av termiskt kol eller okonventionell olja och gas
– är inblandade i en stor ESG-kontrovers (baserat på MSCI ESG-kontroversbetyg)
– har ett ESG-betyg som är lägre än BBB.

Indexet använder en ”bäst i klassen”-metod, vilket är en metod där investeringar som är ledande eller har bäst resultat väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Genom att använda en sådan best-in-class-metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

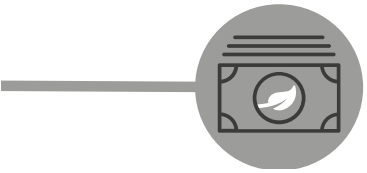
- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

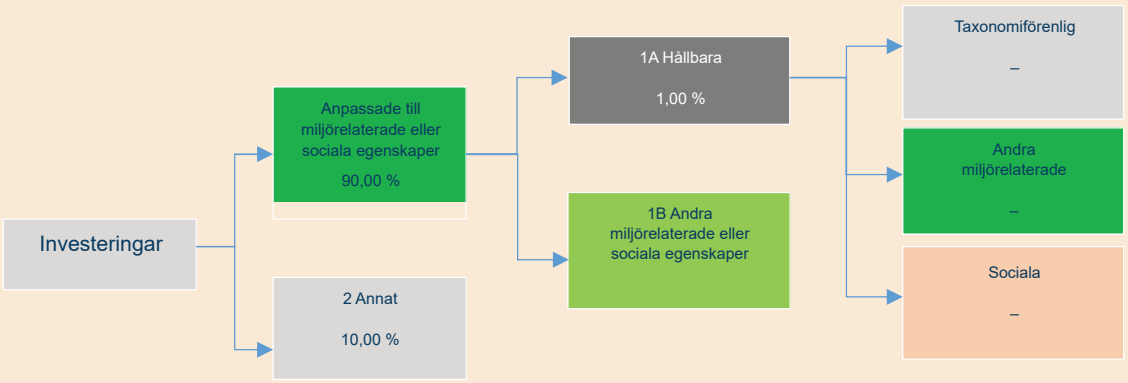
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
–Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
–Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

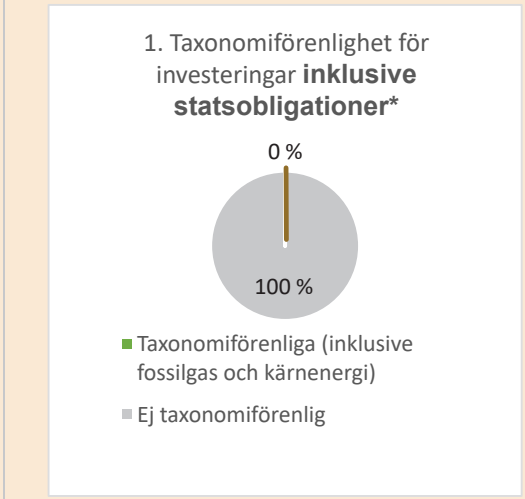
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[51]?***

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[51] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter ärverksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

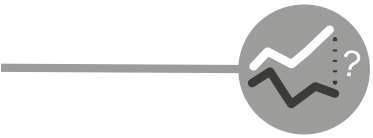
Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Bond Index följer företagsobligationer med fast ränta och hög avkastning och ett minsta utestående nominellt belopp på 300 miljoner USD. Detta index är baserat på Bloomberg US Corporate High Yield Index (”moderindexet”) och tillämpar ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
549300W6M26WPJCWRV83

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt väljer iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”indexet”) bort beståndsdelar i moderindexet baserat på följande kriterier:

1. För det första utesluts värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen.

2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.

3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.

Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:

1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)

2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)

3. emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning).

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld.
De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

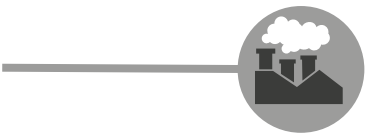
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier.

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[52].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[52] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index är ett obligationsindex som representerar USD-noterade obligationer med rörlig ränta (FRN) och höga kreditbetyg emitterade av företag i utvecklade länder som följer reglerna för iBoxx USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (det ”överordnade indexet”) och tillämpar ESG-kriterier för att värdepappers godtagbarhet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”indexet”) väljer bort beståndsdelar i moderindexet baserat på följande kriterier:

1. För det första utesluts värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen.

2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.

3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.

Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:

1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)

2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)

3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

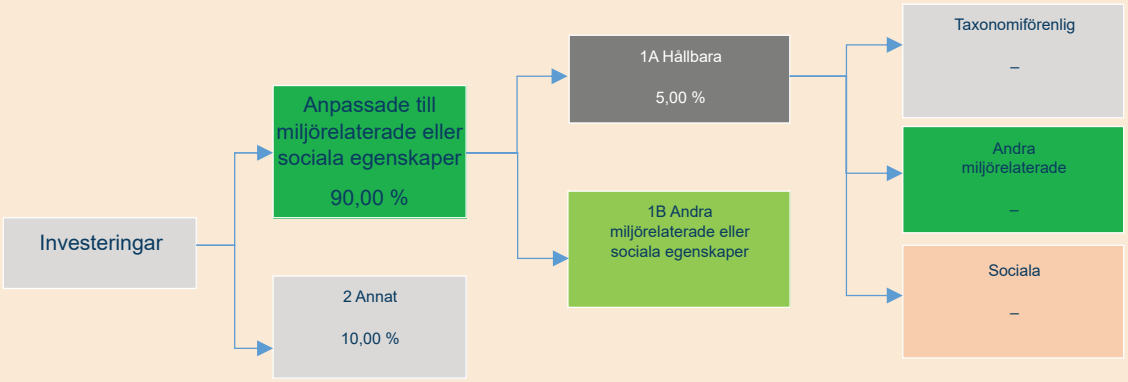
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
–Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
–Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

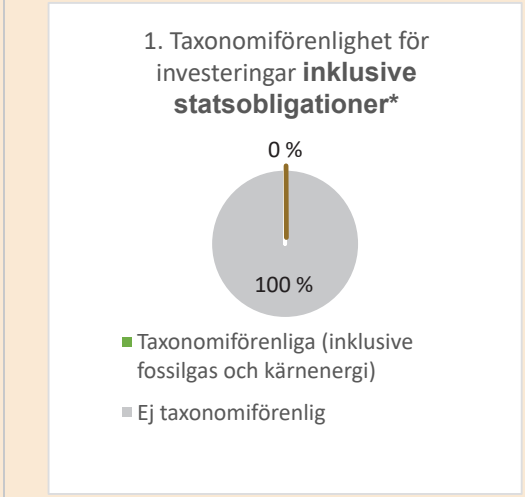
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[53]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[53] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter ärverksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för investment grade-obligationer denominerade i US-dollar, som är emitterade av emittenter från industriländer som följer reglerna i iBoxx USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (”moderindexet”) och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.markit.com/Documentation/Product/Iboxx

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi USD Corporate Bond Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
213800713AA69XKCG155

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ●● ☐ **Ja**
- ●○ ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:
– en minsta minskning av växthusgasutsläpp i förhållande till moderindexet på 50 %

– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasutsläpp i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt avser Bloomberg MSCI USD Corporate PAB Select Index (”indexet”) att vara representativt för marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg denominerade i US-dollar och samtidigt uppfylla och överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Indexet använder en optimeringsmetod som syftar till att minimera den aktiva totala risken med avseende på moderindexet under begränsningar. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och emitterade av företag på utvecklade marknader (”investeringsområdet”) väljer indexmetoden obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till:
1) Minsta utestående belopp på obligationsnivå
2) Återstående löptid
3) Skulders förmånsrätt: Prioriterade och efterställda emissioner ingår
4) emittenter som tilldelas ett ESG-betyg (enligt MSCI:s definition). MSCI:s ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från AAA till CCC. MSCI ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg.

Tillämpningen av urvalskriterierna 1 till 4 leder till ett minskat investeringsområde (det ”godtagbara investeringsområdet”). Det godtagbara investeringsområdet granskas för att utesluta emittenter som
– ägnar sig åt verksamheter som alkohol, hasardspel, tobak, termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, elproduktion, kärnvapen, kontroversiella vapen, konventionella vapen eller civila skjutvapen, baserat på intäktströsklar enligt definitionen i indexmetoden
– är inblandade i en stor ESG-kontrovers (baserat på MSCI ESG-kontroversbetyg)
– är inblandade i miljökontroverser (baserat på MSCI:s miljökontroversbetyg)
– har identifierats bryta mot FN:s Global Compact
– har ett MSCI ESG-betyg som är lägre än BB.

När det godtagbara investeringsområdet har granskats genomförs en optimeringsprocess för urval och viktning av varje värdepapper i indexet för att minimera den aktiva totala risken jämfört med moderindexet och uppfylla standarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Optimeringsprocessen tar bland annat hänsyn till följande begränsningar:
– Klimatbegränsningar såsom, men inte begränsat till:
– En minskning av de viktade genomsnittliga absoluta växthusgasutsläppen jämfört med moderindexet vid startdatumet
– En lägsta årlig minskning av de viktade genomsnittliga absoluta växthusgasutsläppen jämfört med moderindexet
– En minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning jämfört med moderindexet vid startdatumet – En lägsta årlig minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning jämfört med moderindexet.
– Begränsningar för gröna obligationer: gröna obligationers vikt i indexet måste minst motsvara vikten i moderindexet.
– Begränsningar av investeringsbarhet som syftar till att upprätthålla en liknande riskprofil avseende moderindexet (såsom obligationsvikt, avkastning och duration, sektor, land med riskbegränsningar) enligt definitionen i indexmetoden.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslutets mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

– ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
– Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn. – Vara rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter.
– bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier.

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[54].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

[ ] Nej

[54] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI USD Corporate PAB Select Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Bloomberg MSCI USD Corporate PAB Select Index är konstruerat utifrån Bloomberg US Corporate Index (”moderindexet”) och avser att vara representativt för marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg denominerade i US-dollar och samtidigt uppfylla och överträffa minimistandarderna i märkningen EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Indexet fastställer en initial 50 % minskning av koldioxidutsläppen från absoluta utsläpp av växthusgaser och koldioxidintensitet i förhållande till standardindexet Bloomberg US Corporate Index, följt av en årlig 7,35 % minskning av koldioxidutsläppen från båda åtgärderna, och använder en optimeringsmetod som syftar till att minimera den aktiva totala risken med avseende på moderindexet under begränsningar.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Select Index (”indexet”) avser att vara representativt för marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg denominerade i US-dollar och samtidigt uppfylla och överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Indexet använder en optimeringsmetod som syftar till att minimera den aktiva totala risken med avseende på moderindexet under begränsningar.
Inom investeringsområdet med obligationer med höga kreditbetyg som är noterade i US-dollar och emitterade av företag på utvecklade
marknader (”investeringsområdet”) väljer indexmetoden obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till:
1) Minsta utestående belopp på obligationsnivå
2) Återstående löptid
3) Skulders förmånsrätt: Prioriterade och efterställda emissioner ingår
4) emittenter som tilldelas ett ESG-betyg (enligt MSCI:s definition). MSCI:s ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från AAA till CCC. MSCI ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg.

Tillämpningen av urvalskriterierna 1 till 4 leder till ett begränsat investeringsområde (det ”godtagbara investeringsområdet”).
Det godtagbara investeringsområdet granskas för att utesluta emittenter som:
– ägnar sig åt verksamheter som alkohol, hasardspel, tobak, termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, elproduktion, kärnvapen, kontroversiella vapen, konventionella vapen eller civila skjutvapen, baserat på intäktströsklar enligt definitionen i indexmetoden
– är inblandade i en stor ESG-kontrovers (baserat på MSCI ESG-kontroversbetyg)

– är inblandade i miljökontroverser (baserat på MSCI:s miljökontroversbetyg)
– har identifierats bryta mot FN:s Global Compact
– har ett MSCI ESG-betyg som är lägre än BB.

När det godtagbara investeringsområdet har granskats genomförs en optimeringsprocess för urval och viktning av varje värdepapper i indexet för att minimera den aktiva totala risken jämfört med moderindexet och uppfylla standarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Optimeringsprocessen tar bland annat hänsyn till följande begränsningar:
– Klimatbegränsningar såsom, men inte begränsat till:
– En minskning av de viktade genomsnittliga absoluta växthusgasutsläppen jämfört med moderindexet vid startdatumet
– En lägsta årlig minskning av de viktade genomsnittliga absoluta växthusgasutsläppen jämfört med moderindexet
– En minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning jämfört med moderindexet vid startdatumet
– En lägsta årlig minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning jämfört med moderindexet.
– Begränsningar för gröna obligationer: gröna obligationers vikt i indexet måste minst motsvara vikten i moderindexet.
– Begränsningar av investeringsbarhet som syftar till att upprätthålla en liknande riskprofil avseende moderindexet (såsom obligationsvikt, avkastning och duration, sektor, land med riskbegränsningar) enligt definitionen i indexmetoden.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Mer information om de uteslutningar som tillämpas av indexet enligt EU-referensvärdena för anpassning till Parisavtalet finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

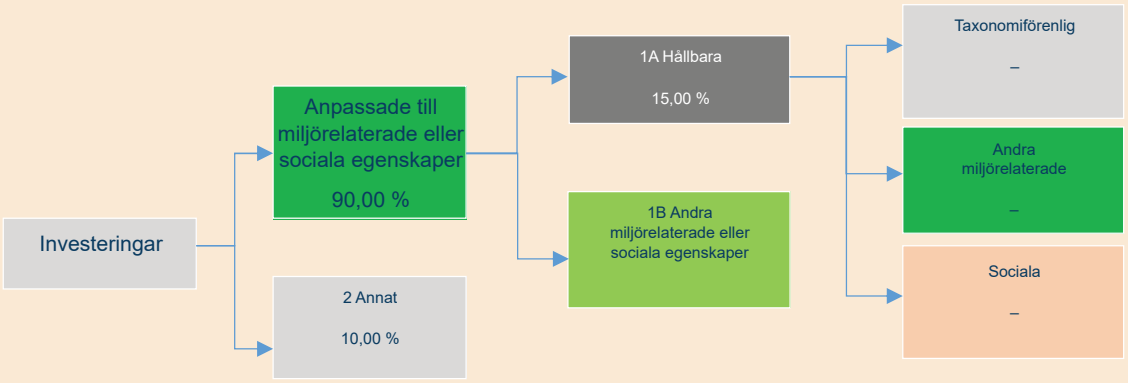
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
–Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
–Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[55]?***

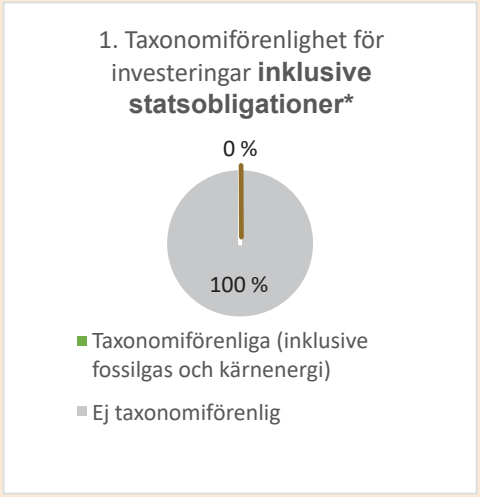
☐ Ja:

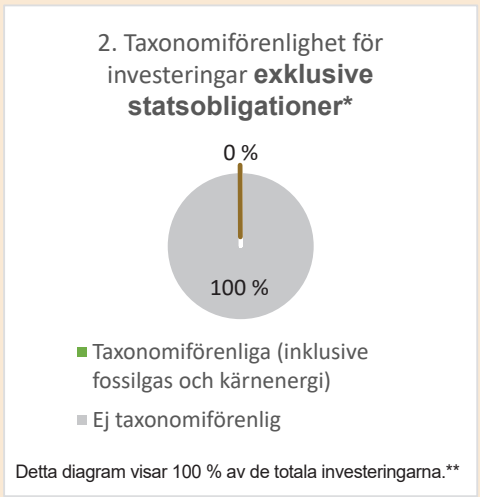
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter ärverksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[55] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att förbinda sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig att ha en minimiandel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

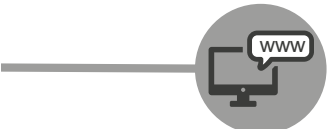
Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI USD Corporate PAB Select Index är konstruerat utifrån Bloomberg US Corporate Index (”moderindexet”) och avser att vara representativt för marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg denominerade i US-dollar och samtidigt uppfylla och överträffa minimistandarderna i märkningen EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Indexet fastställer en initial 50 % minskning av koldioxidutsläppen från absoluta utsläpp av växthusgaser och koldioxidintensitet i förhållande till standardindexet Bloomberg US Corporate Index, följt av en årlig 7,35 % minskning av koldioxidutsläppen från båda åtgärderna, och använder en optimeringsmetod som syftar till att minimera den aktiva totala risken med avseende på det överordnade indexet under begränsningar.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi Global Government Tilted Green Bond

Identifieringskod för juridiska personer:
213800MEFG6O5JHBKE31

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ●● ☐ **Ja**
- ●○ ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 25 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera Bloomberg Global Treasury Green Bond Tilted Index (”referensvärdet”), ett index för statsobligationer i utvecklade länder där de gröna obligationerna är överviktade med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde.

Referensvärdet omfattar standardobligationer och gröna obligationer som är emitterade av utvecklade länder.
De obligationer som anses vara ”gröna obligationer” identifieras med hjälp av data från Bloomberg.

De gröna obligationerna i indexet är obligationer vars nettoobligationsintäkter kommer att vara helt avsedda för grön verksamhet som accepteras på marknaden baserat på Bloombergs klassificering (till exempel men inte endast förnybar energi, energieffektivitet, gröna byggnader och annat). Se www.bloomberg.com för mer information om godtagbara projektkategorier.

De gröna obligationerna granskas av Bloomberg för att säkerställa att de uppfyller minimikriterierna för att klassificeras lämpligt. Kriterierna återspeglar principerna för gröna obligationer som inkluderar:

– Användning av intäkter
– Projekturvalsprocess
– Hantering av intäkter
– Rapportering

Alla gröna obligationer granskas årligen av Bloomberg för att bekräfta att intäkterna används för att stödja gröna projekt. Obligationer med intäkter som inte har bekräftats användas för gröna ändamål klassificeras inte längre som gröna av Bloomberg efter den senaste granskningsprocessen. Sådana värdepapper får ingå i moderindexet och förblir i indexet, men behandlas som icke-gröna obligationer, dvs. inkluderas inte i den totala vikten på 30 % gröna obligationer i indexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den procentandel av fonden som Bloomberg har allokerat till obligationer som anses vara ”gröna obligationer” används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.
Närmare bestämt uppfyller indexet följande kriterier:
– Godtagbara obligationer emitteras av följande stater: Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA.
– Det totala viktade marknadsvärdet för indexet gröna obligationer höjs till 30 %.
– länder som klassificeras som ”inte fria” av Freedom House är uteslutna från indexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen för de hållbara investeringarna är att investera i gröna obligationer emitterade av följande länder: Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA, som uppfyller kriterierna för att inte orsaka betydande skada och minimiskyddsåtgärder enligt indexmetoden.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

– För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada utesluter indexmetoden länder som betecknas som ”inte fria” av Freedom House. Dessutom kommer fonden inte att investera i värdepapper som är emitterade av statliga emittenter på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

– *Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?*

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat baserade på Bloombergs metodik.

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté. Dessutom utesluter referensvärdet statliga emittenter som kategoriseras som ”inte fria” av Freedom House.

– *Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:*

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat. Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex

på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté. Dessutom utesluter referensvärdet statliga emittenter som kategoriseras som ”inte fria” av Freedom House.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för Bloomberg Global Treasury Green Bond Tilted Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Bloomberg Global Treasury Green Bond Tilted Index (Indexet) är ett jämförelseindex för flera valutor som mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med fast ränta för följande länder: Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA. Dessutom höjs det totala viktade marknadsvärdet för indexet gröna obligationer till 30 %.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

- ***Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
Indexet uppfyller följande kriterier:
– Godtagbara obligationer emitteras av följande stater: Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA.
– Det totala viktade marknadsvärdet för indexet gröna obligationer höjs till 30 %.
– länder som klassificeras som ”inte fria” av Freedom House är uteslutna från indexet.
Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

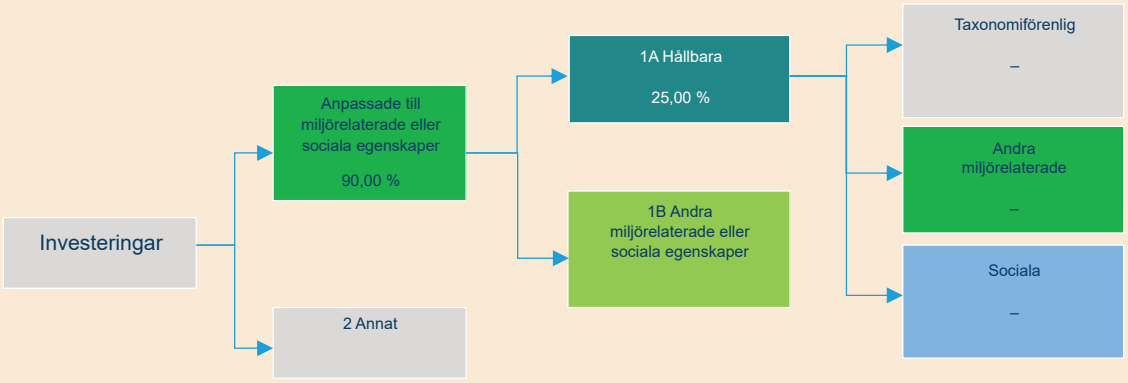
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 25 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
–Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
–Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.
Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[56]?***

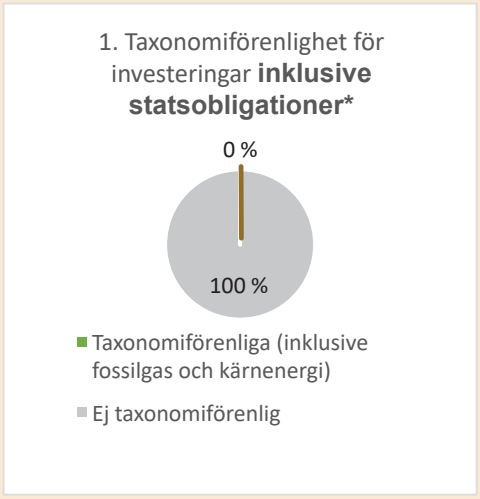
  ☐ Ja:

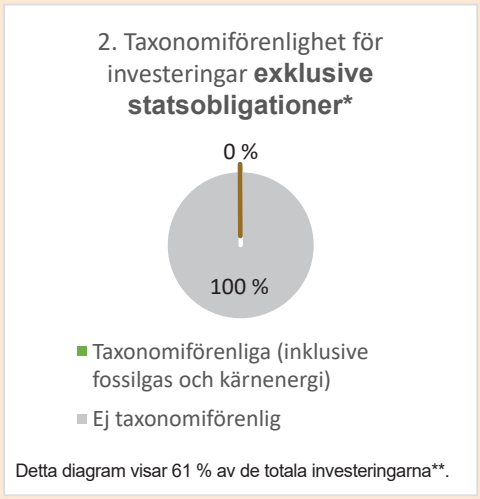
  ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

  ☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter ärverksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är*, visar det första diagrammet överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar som inte är statsobligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[56] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

 är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 25 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



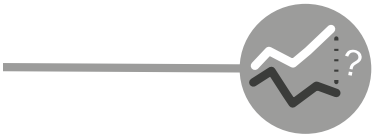
Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 25 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är baserat på ett investeringsområde med globala statsobligationer med standardmarknadsvärde och modifierade vikter för att övervikta de gröna obligationerna. Resultatet blir därför inte detsamma som moderindexets.
Bloomberg Global Treasury Green Bond Tilted Index (Indexet) är ett jämförelseindex för flera valutor som mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med fast ränta för följande länder: Australien, Belgien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Nederländerna, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA. Dessutom höjs det totala viktade marknadsvärdet för indexet gröna obligationer till 30 %.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på:
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi Stoxx Europe 600 ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
549300JX3L7U61W4HF88

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:**_____ %

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 30,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet ett extra långtgående engagemang som gör det möjligt att minska det ursprungliga investeringsuniversumet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

ISS ESG-företagsbetyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

ISS ESG-företagsbetyget tillhandahåller relevanta och framåtblickande data och resultatbedömningar för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG). Med förankring i en helhetssyn på väsentlighet bedöms företagen mot en standarduppsättning universella ESG-teman och ytterligare branschspecifika teman. Väsentlighetsmetoden omfattar både väsentliga hållbarhetsrisker och negativa konsekvenser för samhället och miljön. Med utgångspunkt i en övergripande pool med mer än 700 indikatorer tillämpar ISS ESG cirka 100 sociala, miljö- och styrningsrelaterade indikatorer per betygsatt enhet, som täcker teman som personalfrågor, hantering av leverantörskedjan, affärsetik, bolagsstyrning, miljöstyrning, miljöeffektivitet och andra.

Differentierade viktningsscenarier säkerställer att de teman som är mest väsentliga för ett visst affärsområde/bransch beaktas vederbörligen. Förstklassig status (”Prime”) ges till betygsatta enheter som är ledande inom sina respektive branscher och som uppfyller krävande absoluta resultatförväntningar och därmed ses som väl positionerade för att hantera kritiska ESG-risker och dra nytta av möjligheter som erbjuds av omvandling mot hållbar utveckling.

ESG-företagsbetygsramen erkänner att risker och effekter för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning skiljer sig åt mellan olika branscher. Omfattningen av branschspecifika risker och effekter för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning definierar respektive resultatkrav, fördelningen av vikter mellan dessa betygsdimensioner och den förstklassiga tröskeln per sektor. Företag inom sektorer med hög risk och påverkan som olja och gas måste till exempel visa bättre resultat när det gäller sitt totala betyg än företag i lågrisksektorer som fastigheter för att få den förstklassiga ISS ESG-statusen.

Närmare information om ISS ESG-företagsbetyg finns på följande länk:
https://www.issgovernance.com/file/publications/methodology/Corporate-Rating-Methodology.pdf

Närmare bestämt är STOXX EUROPE 600 ESG+ index ett aktieindex som är baserat på Stoxx Europe 600 (”moderindexet”) och som är representativt för de 600 ledande värdepapperen i utvecklade länder i Europa och som använder en uppsättning sektoruteslutningar och urval baserade på ESG-resultat och har som mål att välja 80 % av de värdepapper som ingår i moderindexet.

Det tillämpliga investeringsområdet består av de företag som ingår i moderindexet.
Sedan tillämpas följande filter:

– Företag som inte är kvalificerade baserat på bedömning enligt ISS-ESG-normbaserad screening utesluts. Normbaserad screening identifierar företag som bryter mot eller riskerar att bryta mot allmänt accepterade internationella normer avseende mänskliga rättigheter, arbetsstandarder, miljöskydd och anti-korruption som fastställts i FN:s Global Compact-principer och OECD:s riktlinjer.

– Företag som av ISS-ESG identifierats syssla med kontroversiella aktiviteter som kontroversiella vapen, tobak, termiskt kol, okonventionell olja och gas, civila skjutvapen och militära kontrakt är inte kvalificerade för urval.

De återstående aktierna i urvalslistan fördelas på elva ICB-branschgrupper enligt deras ICB-klassificeringar.

STOXX EUROPE 600 ESG+ Index inriktas på ett totalt urval av 80 % av antalet aktier från moderindexet. Urvalet tillämpas på alla branschgrupper, de högsta betygen väljs ut och urvalsförhållandet om 80 % bevaras inom varje branschgrupp.

Godtagbara värdepapper i urvalslistan rangordnas i fallande ordning efter sitt ISS ESG-företagsbetyg inom de elva ICB-branschgrupperna. Om två företag i en viss branschgrupp har samma ISS ESG-företagsbetyg ges prioritet till det företag som har högst fritt omsättningsbart börsvärde.

Varje indexkomponent viktas sedan enligt det fritt omsättningsbara börsvärdet med ett tak på 10 %.

Se indexmetoden som finns på stoxx.com för mer information om kontroversiella verksamheter och om urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[57].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

57 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för STOXX EUROPE 600 ESG+ index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

STOXX EUROPE 600 ESG+ Index är ett aktieindex som är baserat på Stoxx Europe 600 (”moderindexet”) som motsvarar de 600 ledande värdepappren i utvecklade länder i Europa, och som använder sektoruteslutningar och uteslutningar baserade på ESG-resultat, och har som mål att välja 80 % av de värdepapper som ingår i moderindexet.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

STOXX EUROPE 600 ESG+ Index är ett aktieindex som är baserat på Stoxx Europe 600 (”moderindexet”) som motsvarar de 600 ledande värdepappren i utvecklade länder i Europa, och som använder sektoruteslutningar och uteslutningar baserade på ESG-resultat, och har som mål att välja 80 % av de värdepapper som ingår i moderindexet.

Det tillämpliga investeringsområdet består av de företag som ingår i moderindexet.
Sedan tillämpas följande filter:

– Företag som inte är kvalificerade baserat på bedömning enligt ISS-ESG-normbaserad screening utesluts. Normbaserad screening identifierar företag som bryter mot eller riskerar att bryta mot allmänt accepterade internationella normer avseende mänskliga rättigheter, arbetsstandarder, miljöskydd och anti-korruption som fastställts i FN:s Global Compact-principer och OECD:s riktlinjer.

– Företag som av ISS-ESG identifierats syssla med kontroversiella aktiviteter som kontroversiella vapen, tobak, termiskt kol, okonventionell olja och gas, civila skjutvapen och militära kontrakt är inte kvalificerade för urval.

De återstående aktierna i urvalslistan fördelas på elva ICB-branschgrupper enligt deras ICB-klassificeringar.

STOXX EUROPE 600 ESG+ Index inriktas på ett totalt urval av 80 % av antalet aktier från moderindexet. Urvalet tillämpas på alla branschgrupper, de högsta betygen väljs ut och urvalsförhållandet om 80 % bevaras inom varje branschgrupp.

Godtagbara värdepapper i urvalslistan rangordnas i fallande ordning efter sitt ISS ESG-företagsbetyg inom de elva ICB-branschgrupperna. Om två företag i en viss branschgrupp har samma ISS ESG-företagsbetyg ges prioritet till det företag som har högst fritt omsättningsbart börsvärde.

Varje indexkomponent viktas sedan enligt det fritt omsättningsbara börsvärdet med ett tak på 10 %.

Se indexmetoden som finns på stoxx.com för mer information om kontroversiella verksamheter och om urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

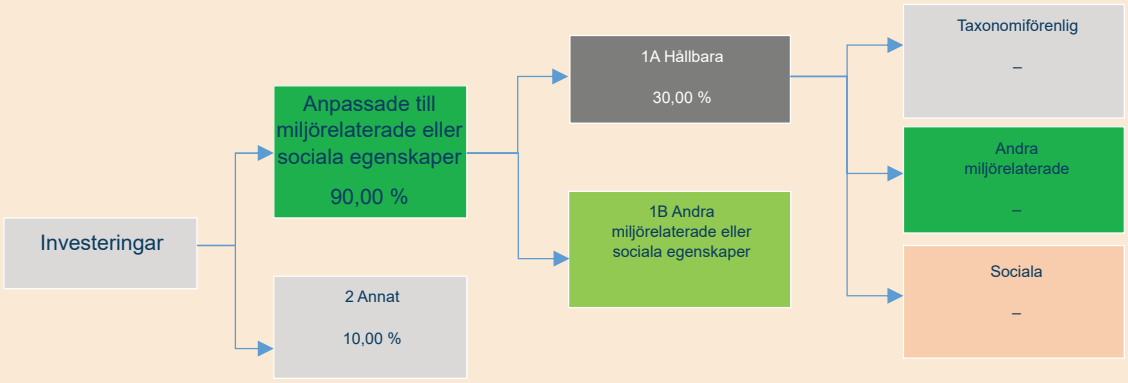
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 30 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– underkategorin Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper, omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

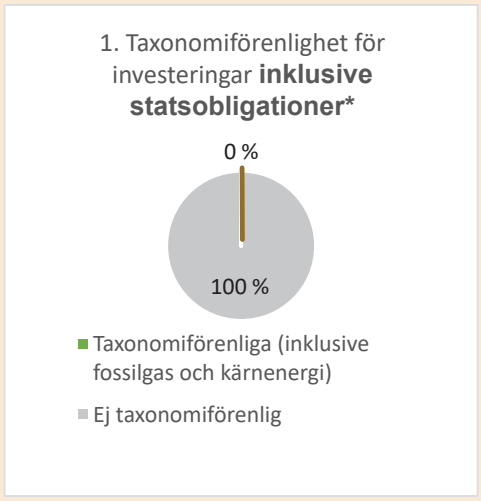
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[58]?***

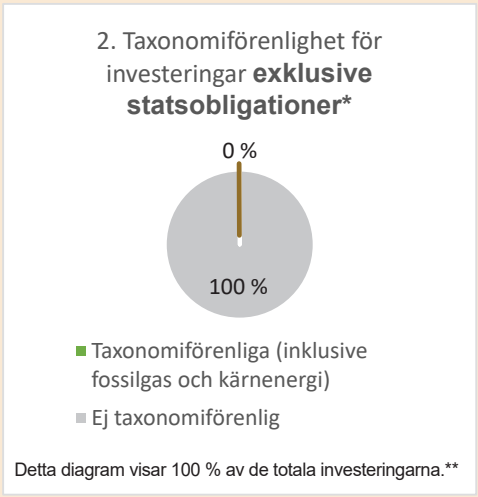
  ☐ Ja:

  ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

  ☒ Nej

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[58] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 30 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 30 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

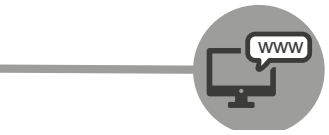
Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

STOXX EUROPE 600 ESG+ Index är ett aktieindex som är baserat på Stoxx Europe 600 (”moderindexet”) som motsvarar de 600 ledande värdepappren i utvecklade länder i Europa, och som använder sektoruteslutningar och uteslutningar baserade på ESG-resultat, och har som mål att välja 80 % av de värdepapper som ingår i moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.stoxx.com/rulebooks



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi S&P 500 Screened

Identifieringskod för juridiska personer:
222100YTW62AGYBTTC41

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

● ● ☐ **Ja**

● ○ ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:**_____ %

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____**%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

S&P DJI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

S&P Dow Jones Indices (S&P DJI), i samarbete med S&P Global Sustainable1 Research, tillhandahåller tillsammans betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) (gemensamt kallade S&P DJI ESG-betyg), som mäter företagens övergripande resultat avseende ekonomiskt väsentliga ESG-faktorer.

S&P Global ESG-betyg innehåller ett totalt ESG-betyg på företagsnivå för ett räkenskapsår och består av enskilda betyg för dimensionerna miljö (E), sociala frågor (S) och bolagsstyrning (G). Under dessa finns (i genomsnitt) mer än 20 branschspecifika kriteriebetyg som kan användas som signaler om ESG-risker och konsekvenser.

Närmare information om S&P DJJ ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/methodologies/methodology-sp-dji-esg-score.pdf

Närmare bestämt innehåller det inledande investeringsområdet för S&P 500 Scored and Screened+ Index (USD) NTR Index alla värdepapper som ingår i dess moderindex.
Sedan tillämpas följande filter:

1. Företag som är involverade i affärsverksamhet som anges i den publicerade indexmetoden, däribland tobak, kontroversiella vapen, okonventionell olja och gas, borrning i Arktis och termiskt kol utesluts.

2. Företag med diskvalificerande poäng* enligt FN:s Global Compact (UNGC) utesluts.

3. Företag som inte har S&P DJI-poäng eller som har S&P DJI ESG-poäng* som ligger inom de 25 % med sämst ESG-poäng från varje GICS-branschgrupp utesluts. Det globala området för denna kategorisering definieras som sammanförandet av S&P Global LargeMidCap och S&P Global 1200 i slutet av mars föregående år.

Indexet eftersträvar 75 % av det fria omsättningsbara börsvärdet i varje branschgrupp inom S&P 500 med S&P DJI ESG-poängen som avgörande drag. Beståndsdelar väljs ut i fallande ordning efter S&P DJI ESG-poäng. Indexets beståndsdelar viktas efter justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

*Läs om indexmetoden på www.spdji.com för mer information om S&P DJI-poäng, UNGC-poäng och miljökontroverser.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i företag som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis

2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt.

För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor.

Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå.

Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget.
För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter.

En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

För att betraktas som en hållbar investering måste ett företag uppfylla ovannämnda mål och bör inte ha någon väsentlig exponering mot verksamheter som anses oförenliga med långsiktiga mål för hållbar utveckling (t.ex. tobak, vapen, spel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödselmedel och bekämpningsmedel, samt tillverkning av engångsplast).

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:
Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn). Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler: • ha en koldioxidintensitet som inte hör till den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) • ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn • bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter • bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar. Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[59].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för S&P 500 Scored and Screened+ Index (USD) NTR Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

S&P 500 Scored and Screened+ Index (USD) NTR Index (”indexet”) är ett brett börsvärdesviktat index som mäter resultatet för värdepapper som uppfyller hållbarhetskriterier, samtidigt som det har liknande sammantagen branschgruppsvikt som S&P 500 (”moderindexet”). S&P500 Index är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas i USA.

59 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Det initiala investeringsområdet för S&P 500 Scored and Screened+ Index (USD) NTR Index innehåller alla värdepapper som ingår i dess moderindex. Sedan tillämpas följande filter:

1.Företag som är involverade i affärsverksamhet som anges i den publicerade indexmetoden, däribland tobak, kontroversiella vapen, okonventionell olja och gas, borrning i Arktis och termiskt kol utesluts.

2. Företag med diskvalificerande poäng* enligt FN:s Global Compact (UNGC) utesluts.

3. Företag som inte har S&P DJI-poäng eller som har S&P DJI ESG-poäng* som ligger inom de 25 % med sämst ESG-poäng från varje GICS-branschgrupp utesluts. Det globala området för denna kategorisering definieras som sammanförandet av S&P Global LargeMidCap och S&P Global 1200 i slutet av mars föregående år.

Indexet eftersträvar 75 % av det fria omsättningsbara börsvärdet i varje branschgrupp inom S&P 500 med S&P DJI ESG-poängen som avgörande drag. Beståndsdelar väljs ut i fallande ordning efter S&P DJI ESG-poäng.

Indexets beståndsdelar viktas efter justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

*Läs om indexmetoden på www.spdji.com för mer information om S&P DJI-poäng, UNGC-poäng och miljökontroverser.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

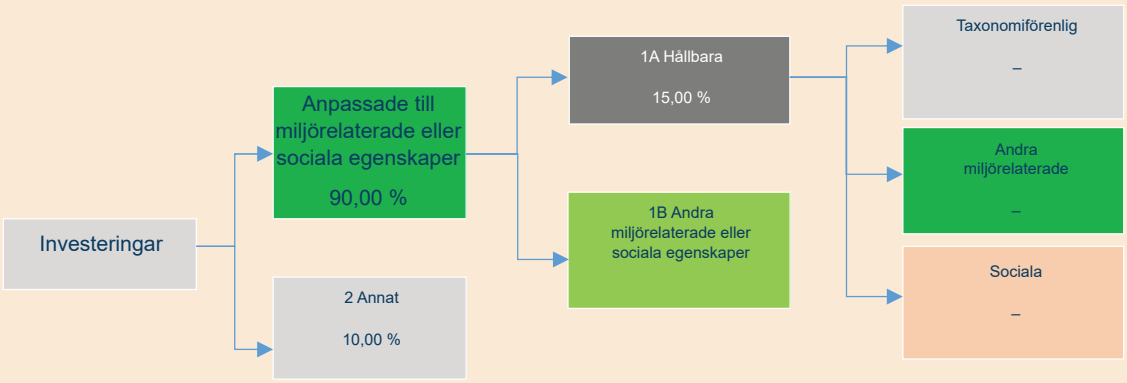
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[60]?***

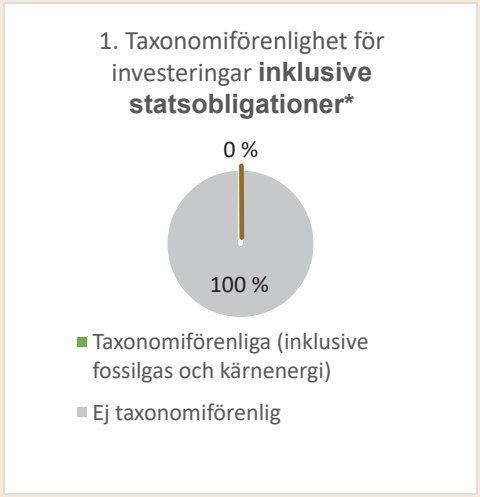
☐ Ja:

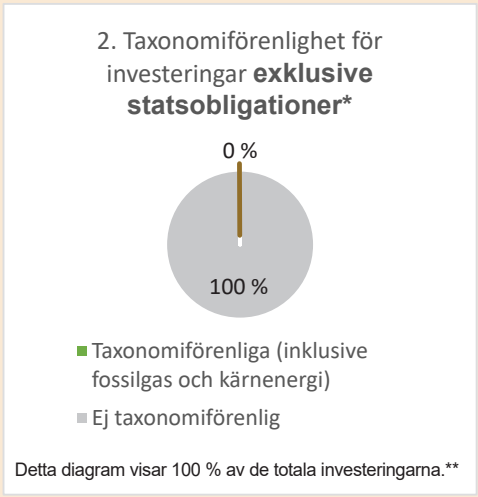
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[60] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

S&P 500 ESG+ Index (”indexet”) är ett brett börsvärdesviktat index som mäter utvecklingen för värdepapper som uppfyller hållbarhetskriterier, samtidigt som det bevarar en sammantagen branschgruppsviktning som den i S&P 500 (”moderindexet”). S&P 500-indexet är ett aktieindex som är representativt för de ledande värdepapper som handlas i USA.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.spglobal.com/spdji/en/index-family/esg/core-esg/sp-esg/#overview



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi PEA MSCI USA ESG Selection

Identifieringskod för juridiska personer:
549300XNMQWJFP5AXO77

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:**_____ %
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är bäst i klassen är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI USA Index, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.
2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara
   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över ”BB” och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över ”1” för att förbli godtagbara.
3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området.

Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[61].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI USA Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper från stora och medelstora företag på den amerikanska marknaden emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

61 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI USA Index, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.
2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara
   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över ”BB” och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över ”1” för att förbli godtagbara.
3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

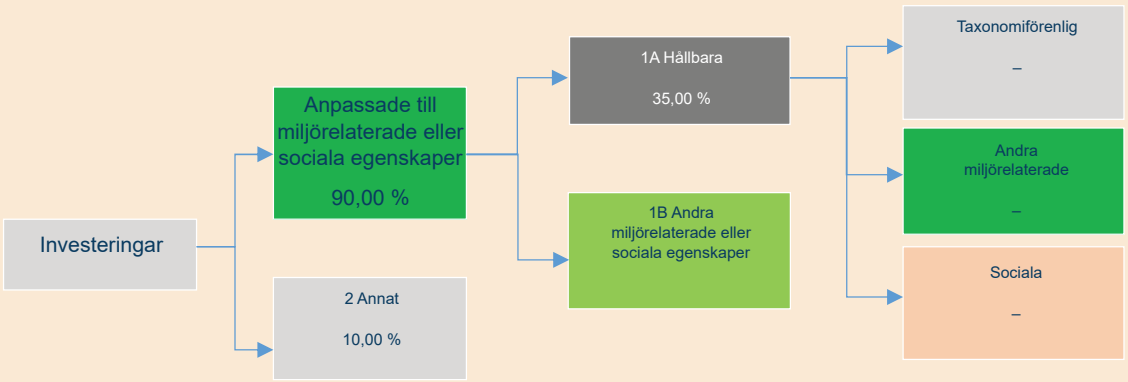
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[62]?

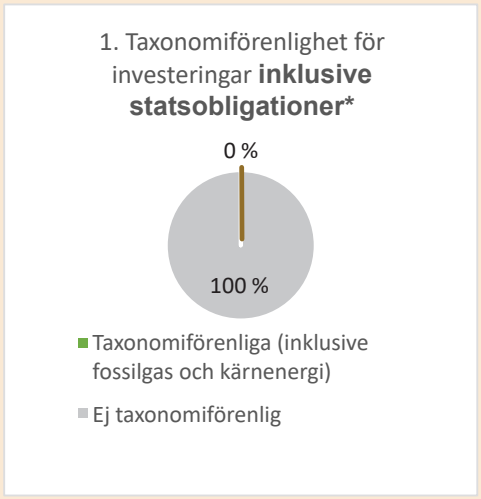
☐ Ja:

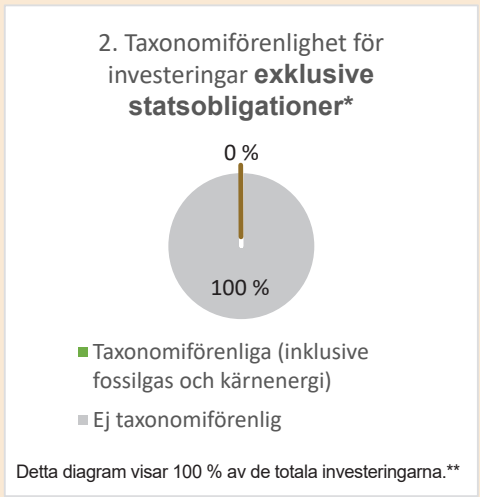
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[62] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 35 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI USA Index (”moderindexet”), representativt för de stora och mellanstora företagens värdepapper på den amerikanska marknaden och emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI World SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
54930067TT873B9E5C67

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:**_____ %

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 30,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____**%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet.

Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

- en minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %
- en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI World SRI Filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.
De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

– MSCI ESG-betyg
– aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
– branschjusterade ESG-poäng
– minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts.

På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer. Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier:

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[63].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI World SRI Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI World SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI World Index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på 23 utvecklade marknader (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

63 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI World SRI Filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

- företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
- de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

- Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
- minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 30,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gaseller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

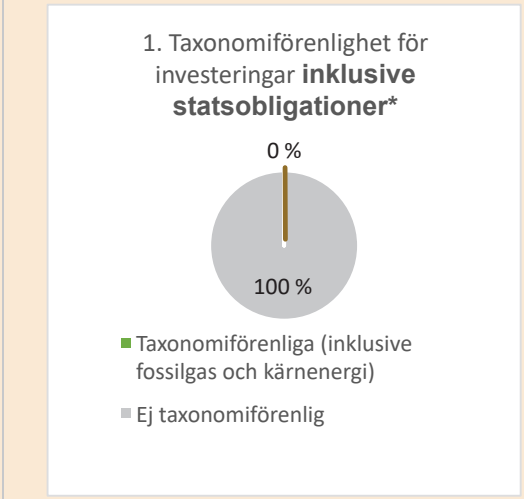
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[64]?

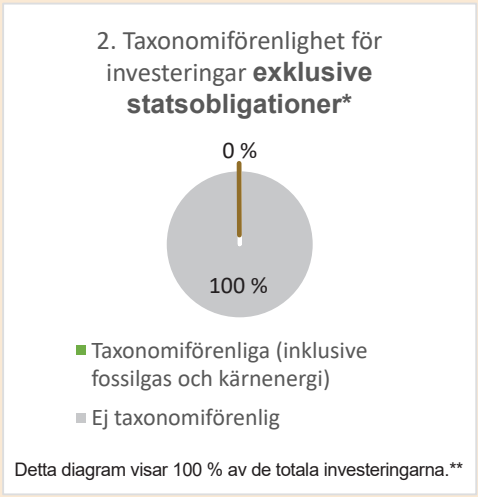
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[64] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 30 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI World SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI World Index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på 23 utvecklade marknader (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Parisavtalet (EU PAB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI World ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
222100479LWJEIXZB875

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet.

Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:
– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.
Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.
– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI World ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %

2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[65].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI World ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI World Index, som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i länder med utvecklade marknader (”**moderindexet**”) och utesluter företag från moderindexet baserat på negativa sociala och miljörelaterade kriterier.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

[65] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
MSCI World ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.
Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

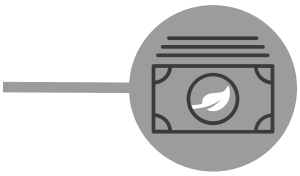
Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

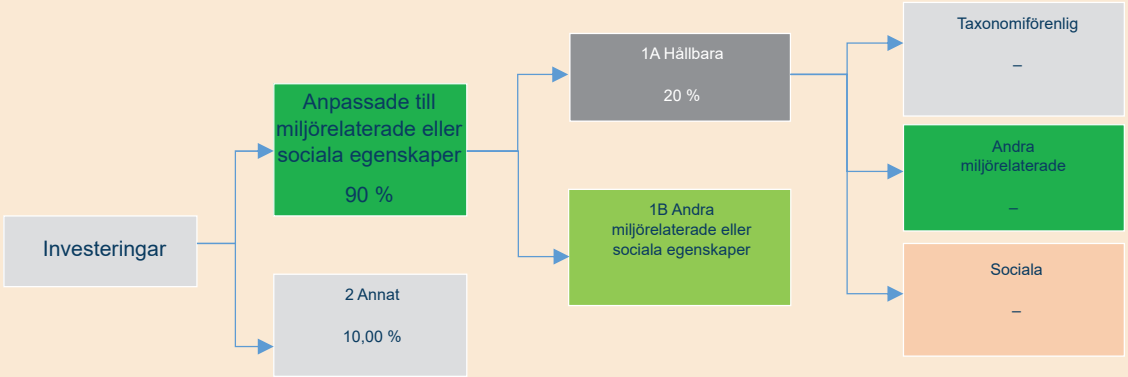
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget minimiåtagande om hållbara investeringar med ett miljömål som är linjerat med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[66]?***

☐ Ja:

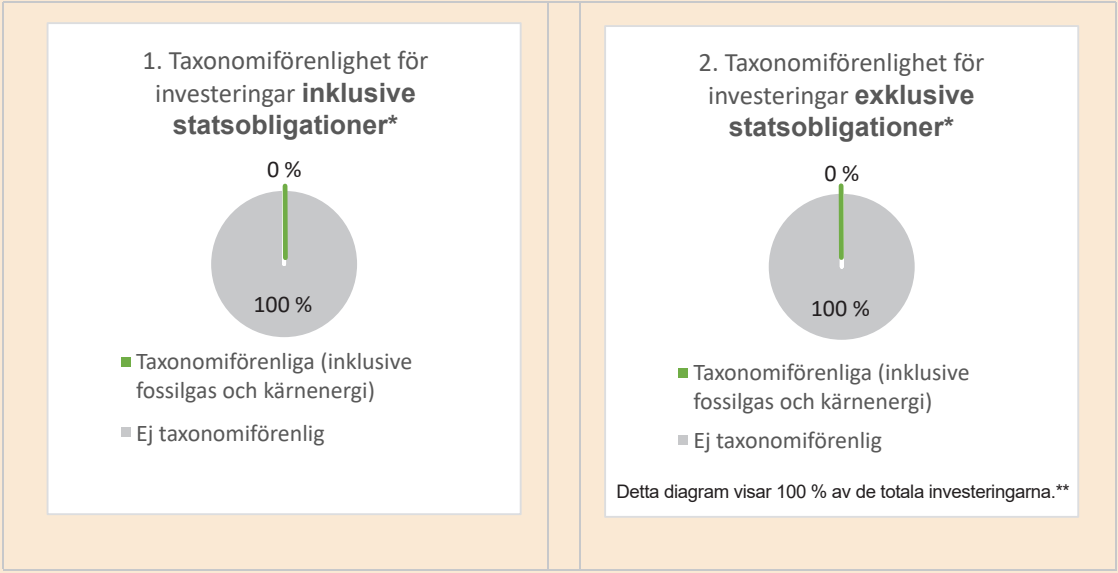
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[66] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.



är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 30 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 30 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?

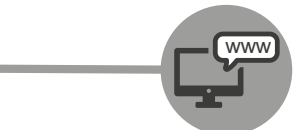
Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI World ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI World Index som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i länder med utvecklade marknader (”**moderindexet**”) och utesluter företag från moderindexet baserat på negativa sociala och miljörelaterade kriterier.
Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i förordningen om Eu-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI USA SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
549300W0L1QTBIEXUI22

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet.

Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.
– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.
– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI USA SRI Filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara.
– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):
- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:
– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

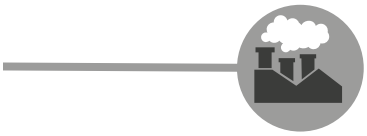
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



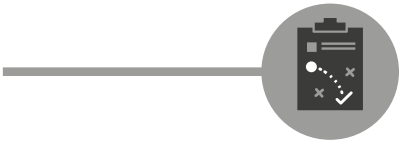
Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[67].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI USA SRI Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

[67] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

MSCI USA SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI USA index och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på den amerikanska marknaden (”moderindexet”). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI USA SRI Filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

- företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
- de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

- överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket – minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet – årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
- minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

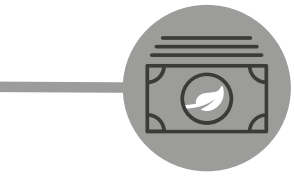
Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



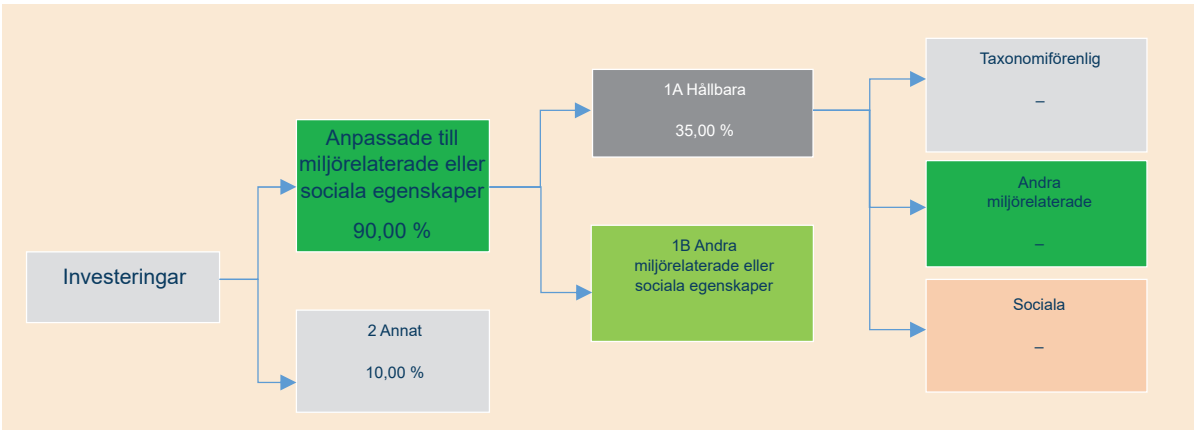
Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram.
Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter



– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gaseller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

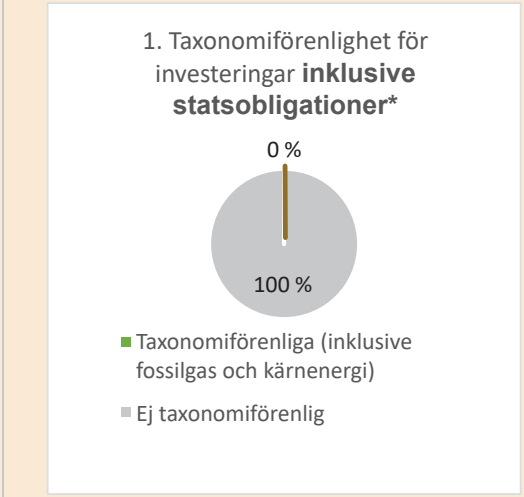
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[68]?***

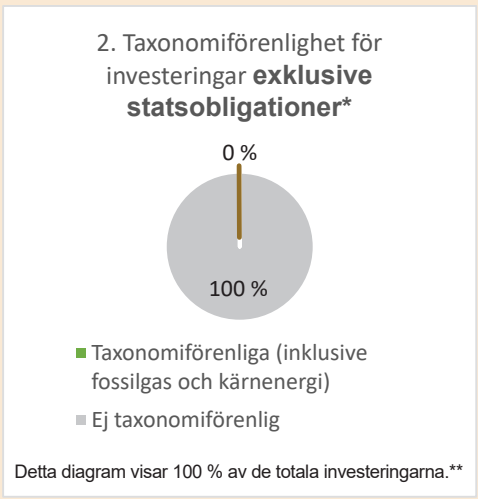
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[68] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är-verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling i både upp- och nedgång, samtidigt som skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning minimeras.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI USA SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI USA index och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på den amerikanska marknaden (”moderindexet”). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI USA ESG Selection

Identifieringskod för juridiska personer:
2138003G3CHCAIBE6B94

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är bäst i klassen är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary. pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen-företag i MSCI USA Index, genom att

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.

2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

   –företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara

   –de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över ”BB” och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över ”1” för att förbli godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

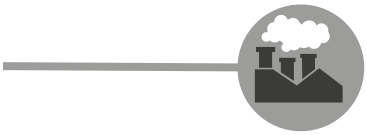
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



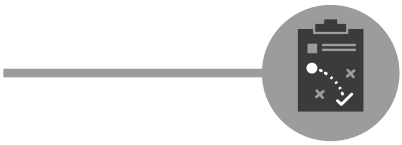
Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[69].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI USA Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper från stora och medelstora företag på den amerikanska marknaden emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

[69] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI USA ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen-företag i MSCI USA Index, genom att

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.

2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara

   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över ”BB” och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över ”1” för att förbli godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

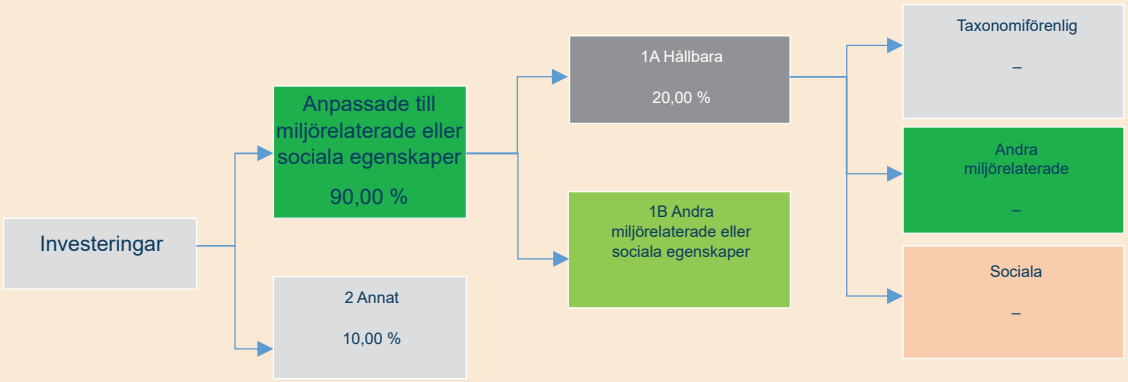
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[70]?***

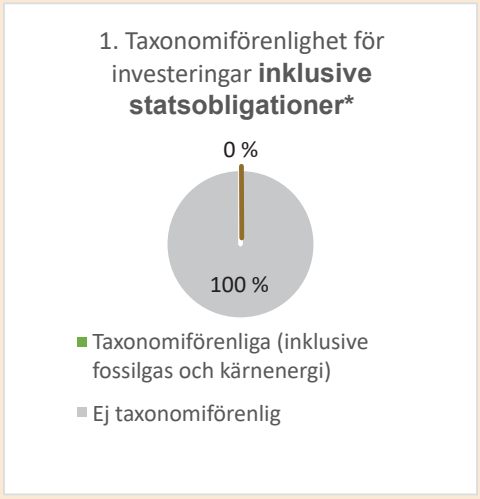
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[70] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214. .

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.


är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



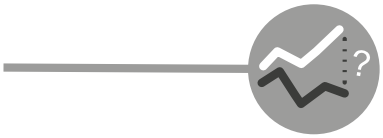
Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI USA Index (”moderindexet”), representativt för de stora och mellanstora företagens värdepapper på den amerikanska marknaden och emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI UK IMI SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
222100W4JS565M7W3C88

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet.
Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

- en minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %
- en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.
- Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
- Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
- Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI UK IMI filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

1. Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research är involverade i kontroversiella verksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslen, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

2. De återstående företagen bedöms därefter utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet.

   - företag som inte redan ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att vara godtagbara
   - beståndsdelarna i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):
- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

4. Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:
   - Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
   - Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

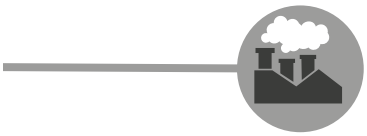
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



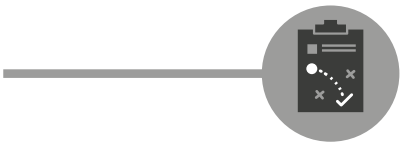
Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[71].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI UK IMI filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
MSCI UK IMI filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI United Kingdom IMI Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper från stora, medelstora och små företag på den brittiska marknaden. Indexet ger exponering mot företag som har högsta betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet, och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

[71] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI UK IMI filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet:

1. Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research är involverade i kontroversiella verksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslen, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

2. De återstående företagen bedöms därefter utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet.
– företag som inte redan ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att vara godtagbara
– beståndsdelarna i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):
- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

4. Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:
– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

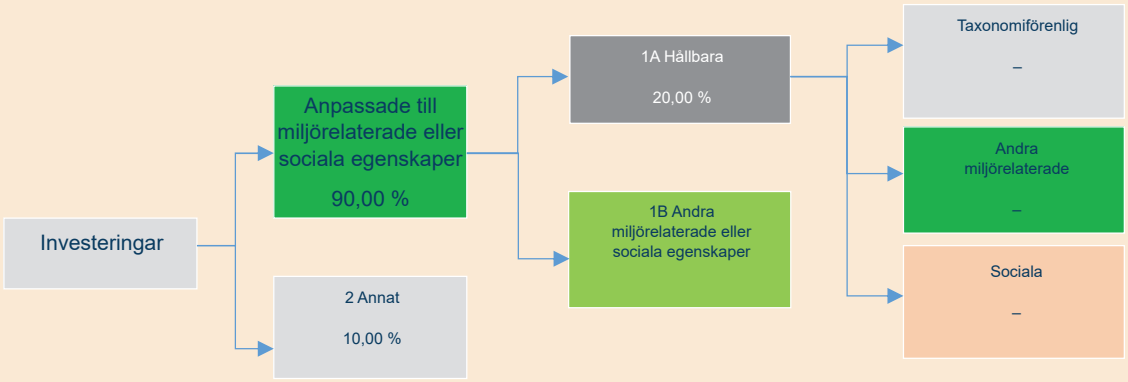
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20,00 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[72]?***

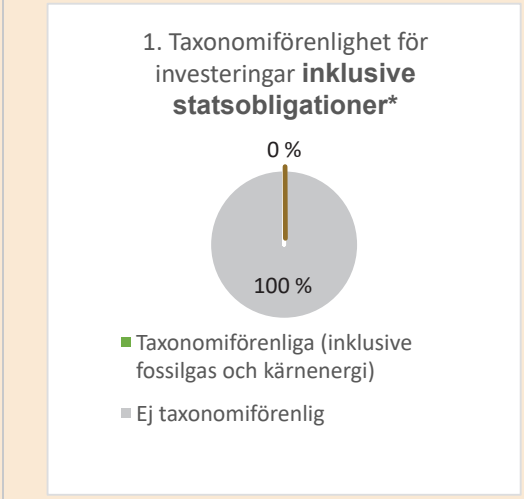
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

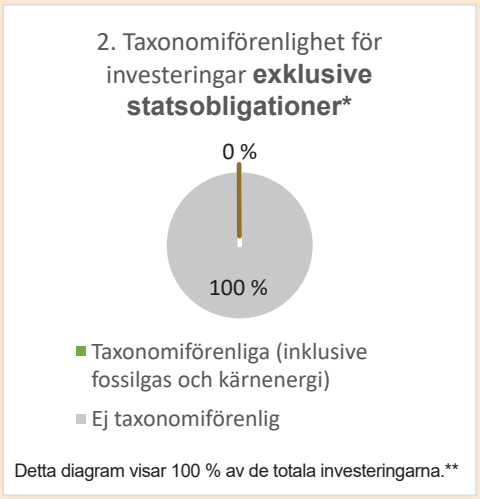
[72] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI UK IMI SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI United Kingdom IMI Index (”moderindexet”), som motsvarar värdepappren för stora, medelstora och små företag på den brittiska marknaden. Indexet ger exponering mot företag som har högsta betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i det överordnade indexet, och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI Smart Cities

Identifieringskod för juridiska personer:
5493004ZDNQO27QH8R39

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”). Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad
metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen.

Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Indexet sätts samman genom urval av aktier från MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”moderindexet”). Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som:
– Smart anslutning (IoT)
– Smart infrastruktur – Smarta byggnader
– Smarta hem – Smart säkerhet
– Smart mobilitet
– Smart avfalls- och vattenhantering
– Smart energi och elnät

– Närmare bestämt är indexet ett aktieindex som beräknas och publiceras av den internationella indexleverantören MSCI. Indexet har följande egenskaper:

a) Samma investeringsområde som MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”moderindexet”), dvs. inklusive aktier i stora, medelstora och små företag i utvecklade länder och tillväxtländer.

b) En uppsättning relevanta ord och fraser som härrör från ovanstående affärsverksamheter används för att identifiera företag (”det godtagbara investeringsområdet”) som kan dra nytta av den ökade användningen av produkter och tjänster som är inriktade på automatisering och artificiell intelligens.

c) Företag från det godtagbara investeringsområdet med ett ”relevansbetyg” (enligt MSCI:s definition) över 25 % utgör det ”valda investeringsområdet”.

d) Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sektor tillämpas på det valda investeringsområdet.

e) Ett ESG-urval för uteslutning tillämpas på det valda investeringsområdet enligt definitionen i metoden för att utesluta

– företag med exponering mot kontroversiella verksamheter som kontroversiella vapen, konventionella vapen, tobak, termiskt kol, civila skjutvapen, oljesand, kärnvapen eller företag som bryter mot FN:s Global Compact

– företag utan ESG-betyg (enligt MSCI:s definition).

f) Ett filtrerat investeringsområde konstrueras med hjälp av en metod för företag som är bäst i klassen (det ”filtrerade investeringsområdet”): företag i den nedre kvartilen efter ESG-branschjusterade betyg (enligt MSCI:s definition) utesluts från det filtrerade valda investeringsområdet. Metoden för företag som är bäst i klassen är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Med hjälp av en sådan metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter). Gränserna för den icke-finansiella metoden anges i avsnittet ”Huvudsakliga risker” nedan. Den icke-finansiella datatäckningen är 100 % av de godtagbara värdepapperen i moderindexet. Företag utan ESG-betyg utesluts från indexets urvalsprocess.

g) Den övre halvan vad gäller relevansbetyg för det filtrerade investeringsområdet utgör indexsammansättningen.

h) Indexet viktas i enlighet med MSCI Adaptive Capped Indexes Methodology (som beskrivs på MSCI:s webbplats), med fast multiplikator (”L”) inställd på 5. Denna metod syftar till att generera ett begränsat index med hög replikerbarhet och låg omsättning och en fördefinierad maximal begränsningsfaktor för de icke-begränsade beståndsdelarna i indexet.

i) En iterativ nedviktning säkerställer att koldioxidintensiteten och det viktade genomsnittet av styrelsens oberoende i indexet är lägre respektive högre än för MSCI ACWI IMI Smart Cities Index. Mer information om delfondens allmänna och specifika mål för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) finns i delfondens öppenhetskod på https://www.amundietf.com. Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av delfonden uppfylls genom MSCI ESG-betygsmetoden (enligt beskrivningen ovan).

Indexets fullständiga metod (inklusive underhåll och ombalansering av indexet) är tillgänglig på MSCI:s webbplats: https://www.msci.com/index-methodology. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1. följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2. undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå. För att betraktas som en hållbar investering måste ett företag uppfylla ovanstående mål och inte ha någon betydande exponering mot verksamheter som anses oförenliga med långsiktiga mål för hållbar utveckling (t.ex. koldioxidintensiv energiproduktion och -distribution, tobak, vapen, spel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk).

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första filtret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[73].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI ACWI IMI Smart Cities Filtered (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet strävar efter att representera resultatet för företag som förväntas få betydande intäkter från verksamheter som är förknippade med utveckling av nya produkter och tjänster som är inriktade på smarta lösningar för stadsinfrastruktur och utesluter företag som ligger efter med miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”) i förhållande till temats område.

[73] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Indexet sätts samman genom urval av aktier från MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”moderindexet”). Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som:
– Smart anslutning (IoT)
– Smart infrastruktur
– Smarta byggnader
– Smarta hem
– Smart säkerhet
– Smart mobilitet
– Smart avfalls- och vattenhantering
– Smart energi och elnät
Indexet är ett aktieindex som beräknas och publiceras av den internationella indexleverantören MSCI.

Indexet har följande egenskaper:

a) Samma investeringsområde som MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”moderindexet”), dvs. inklusive aktier i stora, medelstora och små företag i utvecklade länder och tillväxtländer.

b) En uppsättning relevanta ord och fraser som härrör från ovanstående affärsverksamheter används för att identifiera företag (”det godtagbara investeringsområdet”) som kan dra nytta av den ökade användningen av produkter och tjänster som är inriktade på automatisering och artificiell intelligens.

c) Företag från det godtagbara investeringsområdet med ett ”relevansbetyg” (enligt MSCI:s definition) över 25 % utgör det ”valda investeringsområdet”.

d) Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sektor tillämpas på det valda investeringsområdet.

e) Ett ESG-urval för uteslutning tillämpas på det valda investeringsområdet enligt definitionen i metoden för att utesluta:

- företag med exponering mot kontroversiella verksamheter som kontroversiella vapen, konventionella vapen, tobak, termiskt kol, civila skjutvapen, oljesand, kärnvapen eller företag som bryter mot FN:s Global Compact

- företag utan ESG-betyg (enligt MSCI:s definition).

f) Ett filtrerat investeringsområde konstrueras med hjälp av en metod för företag som är bäst i klassen (det ”filtrerade investeringsområdet”): företag i den nedre kvartilen efter ESG-branschjusterade betyg (enligt MSCI:s definition) utesluts från det filtrerade valda investeringsområdet. Metoden för företag som är bäst i klassen är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Med hjälp av en sådan metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter). Gränserna för den icke-finansiella metoden anges i avsnittet ”Huvudsakliga risker” nedan. Den icke-finansiella datatäckningen är 100 % av de godtagbara värdepapperen i moderindexet. Företag utan ESG-betyg utesluts från indexets urvalsprocess.

g) Den övre halvan vad gäller relevansbetyg för det filtrerade investeringsområdet utgör indexsammansättningen.

h) Indexet viktas i enlighet med MSCI Adaptive Capped Indexes Methodology (som beskrivs på MSCI:s webbplats), med fast multiplikator (”L”) inställd på 5. Denna metod syftar till att generera ett begränsat index med hög replikerbarhet och låg omsättning och en fördefinierad maximal begränsningsfaktor för de icke-begränsade beståndsdelarna i indexet.

i) En iterativ nedviktning säkerställer att koldioxidintensiteten och det viktade genomsnittet av styrelsens oberoende i indexet är lägre respektive högre än för MSCI ACWI IMI Smart Cities Index.

Mer information om delfondens allmänna och specifika mål för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) finns i delfondens öppenhetskod på https://www.amundietf.com. Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av delfonden uppfylls genom MSCI ESG-betygsmetoden (enligt beskrivningen ovan).

Indexets fullständiga metod (inklusive underhåll och ombalansering av indexet) är tillgänglig på MSCI:s webbplats: https://www.msci.com/index-methodology. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

För att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

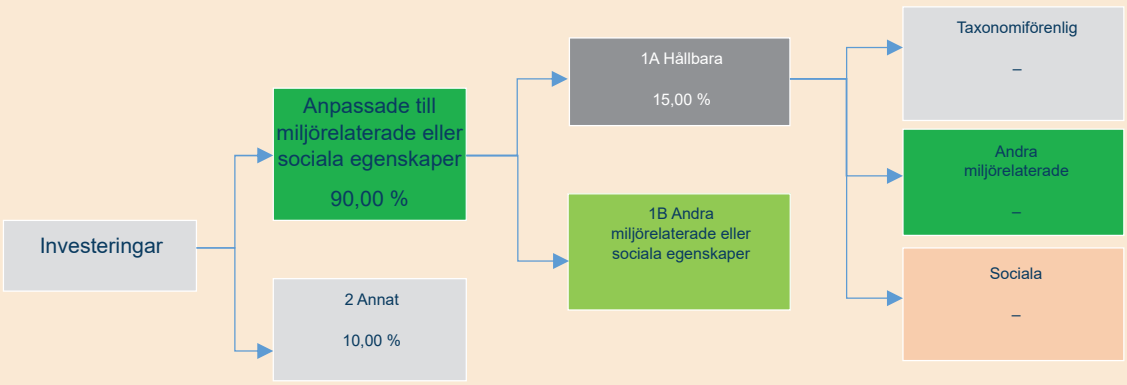
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget minimiåtagande om hållbara investeringar med ett miljömål som är linjerat med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[74]?***

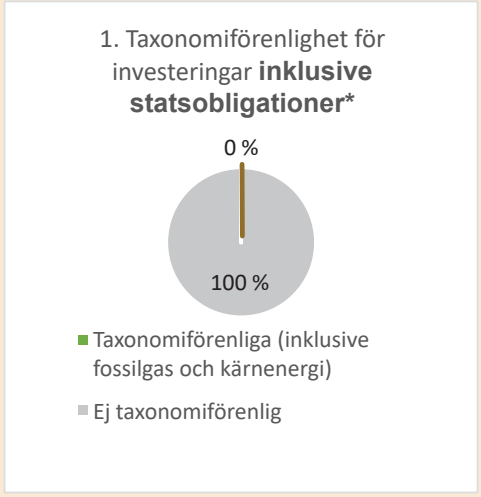
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[74] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet strävar efter att representera resultatet för företag som förväntas få betydande intäkter från verksamheter som är förknippade med utveckling av nya produkter och tjänster som är inriktade på smarta lösningar för stadsinfrastruktur och utesluter företag som ligger efter med miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”) i förhållande till temats område.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på: www.MSCI.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Robotics & AI

Identifieringskod för juridiska personer:
54930038GH5HM293HY35

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 10,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod

följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor
som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt har indexet följande egenskaper:

a) Samma investeringsområde som MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”moderindexet”), dvs. inklusive aktier i stora, medelstora och små företag i utvecklade länder och tillväxtländer.

b) En uppsättning relevanta ord och fraser som härrör från ovanstående affärsverksamheter används för att identifiera företag (”det godtagbara investeringsområdet”) som kan dra nytta av den ökade användningen av produkter och tjänster som är inriktade på automatisering och artificiell intelligens.

c) Företag från det godtagbara investeringsområdet med ett ”relevansbetyg” (enligt MSCI:s definition) över 25 % utgör det ”valda investeringsområdet”.

d) Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sektor tillämpas på det valda investeringsområdet.

e) Ett ESG-urval för uteslutning tillämpas på det valda investeringsområdet enligt definitionen i metoden för att utesluta:
   – företag med exponering mot kontroversiella verksamheter som kontroversiella vapen, konventionella vapen, tobak, termiskt kol, civila skjutvapen, oljesand, kärnvapen eller företag som bryter mot FN:s Global Compact
   – företag utan ESG-betyg (enligt MSCI:s definition).

f) Ett filtrerat investeringsområde konstrueras med hjälp av en metod för företag som är bäst i klassen (det ”filtrerade investeringsområdet”): företag i den nedre kvartilen efter

ESG-branschjusterade betyg (enligt MSCI:s definition) utesluts från det filtrerade valda investeringsområdet. Metoden för företag som är bäst i klassen är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass.

MSCI ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. Med hjälp av en sådan metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter). Gränserna för den icke-finansiella metoden anges i avsnittet ”Huvudsakliga risker” nedan. Den icke-finansiella datatäckningen är 100 % av de godtagbara värdepapperen i moderindexet. Företag utan ESG-betyg utesluts från indexets urvalsprocess.

g) Den övre halvan vad gäller relevansbetyg för det filtrerade investeringsområdet utgör indexsammansättningen.

h) Indexet viktas i enlighet med MSCI Adaptive Capped Indexes Methodology (som beskrivs på MSCI:s webbplats), med fast multiplikator (”L”) inställd på 5. Denna metod syftar till att generera ett begränsat index med hög replikerbarhet och låg omsättning och en fördefinierad maximal begränsningsfaktor för de icke-begränsade beståndsdelarna i indexet.

i) En iterativ nedviktning säkerställer att koldioxidintensiteten och det viktade genomsnittet av styrelsens oberoende i indexet är lägre respektive högre än för MSCI ACWI IMI Robotics & AI Index. Mer information om delfondens allmänna och specifika mål för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) finns i delfondens öppenhetskod på https://www.lyxoretf.com/. Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av delfonden uppfylls genom MSCI ESG-betygsmetoden (enligt beskrivningen ovan).

Indexets fullständiga metod (inklusive underhåll och ombalansering av indexet) är tillgänglig på MSCI:s webbplats: https://www.msci.com/index-methodology.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

  Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

  1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
  2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

  Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga

faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.

– **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[75].
– **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI ACWI IMI Robotics & AI Filtered (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet strävar efter att återspegla resultatet för företag som är förknippade med den ökade användningen av artificiell intelligens, robotar och automatisering och samtidigt utesluta företag som ägnar sig åt vissa kontroversiella verksamheter eller som har låga ESG-kontroversbetyg och ESG-betyg (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som – Robotteknik/artificiell intelligens, – IoT/smarta hem, – Molntjänster, – Cybersäkerhet, – Medicinsk robotteknik, – Automatisering av sociala medier, – Automatisering av fordon.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Indexet har följande egenskaper:

a) Samma investeringsområde som MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) (”moderindexet”), dvs. inklusive aktier i stora, medelstora och små företag i utvecklade länder och tillväxtländer.

b) En uppsättning relevanta ord och fraser som härrör från ovanstående affärsverksamheter används för att identifiera företag (”det godtagbara investeringsområdet”) som kan dra nytta av den ökade användningen av produkter och tjänster som är inriktade på automatisering och artificiell intelligens.

c) Företag från det godtagbara investeringsområdet med ett ”relevansbetyg” (enligt MSCI:s definition) över 25 % utgör det ”valda investeringsområdet”.

[75] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

d) Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sektor tillämpas på det valda investeringsområdet.

e) Ett ESG-urval för uteslutning tillämpas på det valda investeringsområdet enligt definitionen i metoden för att utesluta:
   – företag med exponering mot kontroversiella verksamheter som kontroversiella vapen, konventionella vapen, tobak, termiskt kol, civila skjutvapen, oljesand, kärnvapen eller företag som bryter mot FN:s Global Compact
   – företag utan ESG-betyg (enligt MSCI:s definition).

f) Ett filtrerat investeringsområde konstrueras med hjälp av en metod för företag som är bäst i klassen (det ”filtrerade investeringsområdet”): företag i den nedre kvartilen efter ESG-branschjusterade betyg (enligt MSCI:s definition) utesluts från det filtrerade valda investeringsområdet. Metoden för företag som är bäst i klassen är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass.

MSCI ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. Med hjälp av en sådan metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter). Gränserna för den icke-finansiella metoden anges i avsnittet ”Huvudsakliga risker” nedan. Den icke-finansiella datatäckningen är 100 % av de godtagbara värdepapperen i moderindexet. Företag utan ESG-betyg utesluts från indexets urvalsprocess.

g) Den övre halvan vad gäller relevansbetyg för det filtrerade investeringsområdet utgör indexsammansättningen.

h) Indexet viktas i enlighet med MSCI Adaptive Capped Indexes Methodology (som beskrivs på MSCI:s webbplats), med fast multiplikator (”L”) inställd på 5. Denna metod syftar till att generera ett begränsat index med hög replikerbarhet och låg omsättning och en fördefinierad maximal begränsningsfaktor för de icke-begränsade beståndsdelarna i indexet.

i) En iterativ nedviktning säkerställer att koldioxidintensiteten och det viktade genomsnittet av styrelsens oberoende i indexet är lägre respektive högre än för MSCI ACWI IMI Robotics & AI Index. Mer information om delfondens allmänna och specifika mål för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) finns i delfondens öppenhetskod på https://www.lyxoretf.com/. Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av delfonden uppfylls genom MSCI ESG-betygsmetoden (enligt beskrivningen ovan).

Mer information om delfondens allmänna och specifika mål för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) finns i delfondens öppenhetskod på https://www.lyxoretf.com. Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av delfonden uppfylls genom MSCI ESG-betygsmetoden (enligt beskrivningen ovan).

Indexets fullständiga metod (inklusive underhåll och ombalansering av indexet) är tillgänglig på MSCI:s webbplats: https://www.msci.com/index-methodology. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

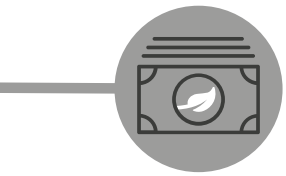
Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju steg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

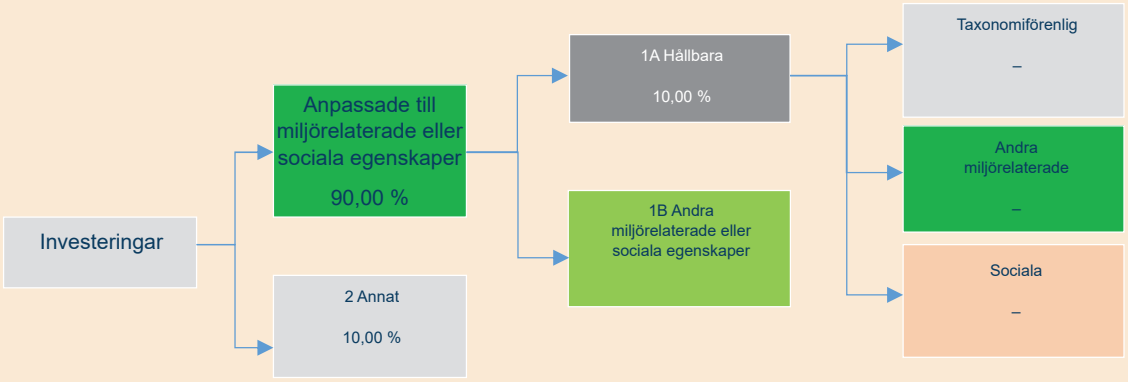
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 10,00 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gaseller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

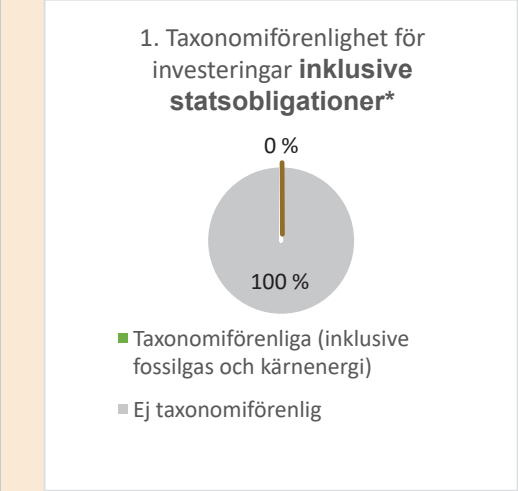
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[76]?***

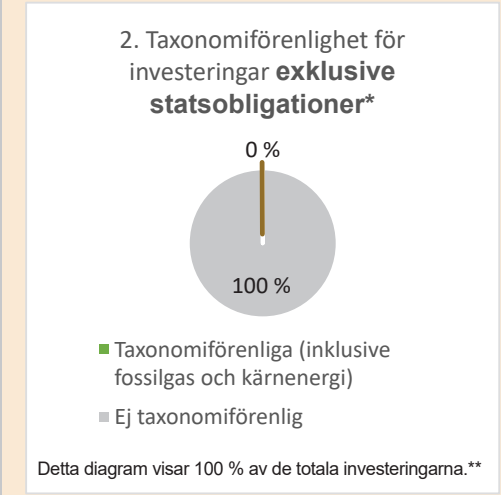
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[76] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 10 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 10 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet strävar efter att återspegla resultatet för företag som är förknippade med den ökade användningen av artificiell intelligens, robotar och automatisering och samtidigt utesluta företag som ägnar sig åt vissa kontroversiella verksamheter eller som har låga ESG-kontroversbetyg och ESG-betyg (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som – Robotteknik/artificiell intelligens, – IoT/smarta hem, – Molntjänster, – Cybersäkerhet, – Medicinsk robotteknik, – Automatisering av sociala medier, – Automatisering av fordon.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på msci.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi EUR Corporate Bond 0-3Y ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
5493003U13Y6UYB5XW65

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG Euro Corp BBB+ 0-3 Year Select Index (”indexet”) följande filter:

1. De värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre.

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.

3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:

- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och

tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[77].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[77] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corp BBB+ 0-3 Year Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI ESG Euro Corp BBB+ 0-3 Year Select Index är ett obligationsindex som är representativt för obligationer med höga kreditbetyg denominerade i euro som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”moderindexet”) med en återstående löptid på 0 eller 3 år och tillämpar ytterligare sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI ESG Euro Corp BBB+ 0-3 Year Select Index (”indexet”) tillämpar följande filter:

1. De värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre.

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.

3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att
rangordnas enligt följande kriterier:

- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

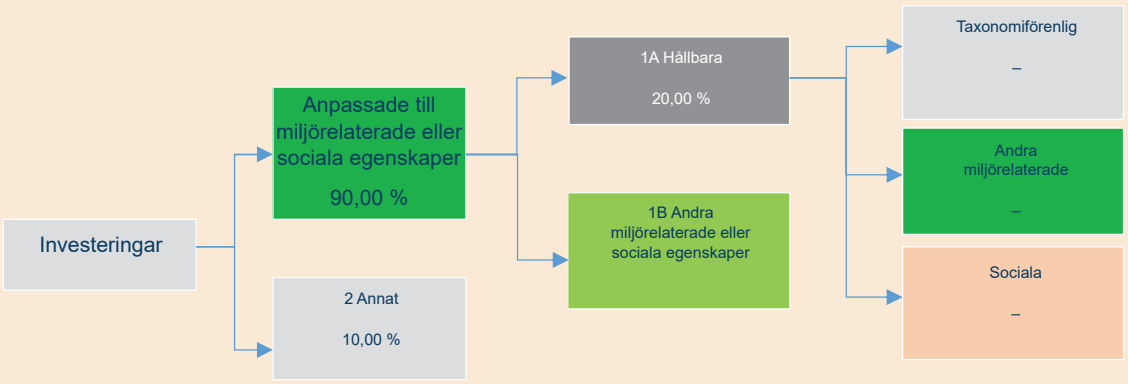
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas och/eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

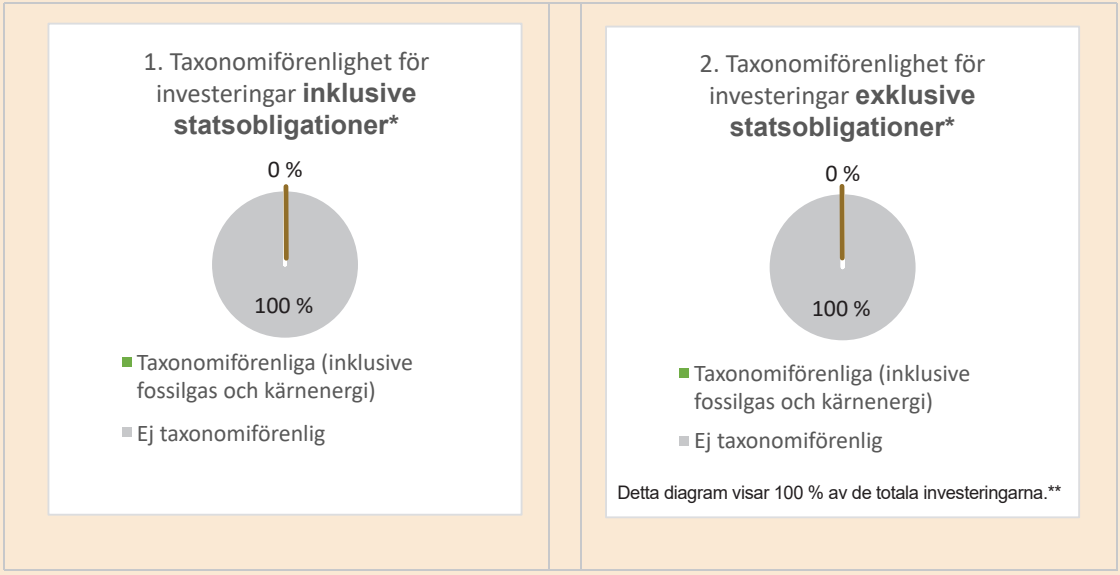
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[78]?***

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[78] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index är ett obligationsindex som motsvarar obligationer som är denominerade i euro med höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”moderindexet”), med återstående löptid på 0 eller 3 år och som använder ytterligare sektor- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Pacific Ex Japan SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
22210085PY3LW5RGLP55

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.
– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i de regionala index som utgör moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

– MSCI ESG-betyg
– ESG-trend (positiv ESG-trend föredras framför neutral ESG-trend och neutral ESG-trend föredras framför negativ ESG-trend)
– aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
– branschjusterade ESG-poäng
– minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet.

Den högsta vikten av en indexbeståndsdel på emittentnivå begränsas till 5 % (vikten i moderindexet).

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[79].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

[79] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI Pacific ex Japan Index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag i 4 av 5 industriländer i Stillahavsområdet undantaget Japan (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i de regionala index som utgör moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.
En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets.
Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.
Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):
- MSCI ESG-betyg
- ESG-trend (positiv ESG-trend föredras framför neutral ESG-trend och neutral ESG-trend föredras framför negativ ESG-trend)
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.
Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

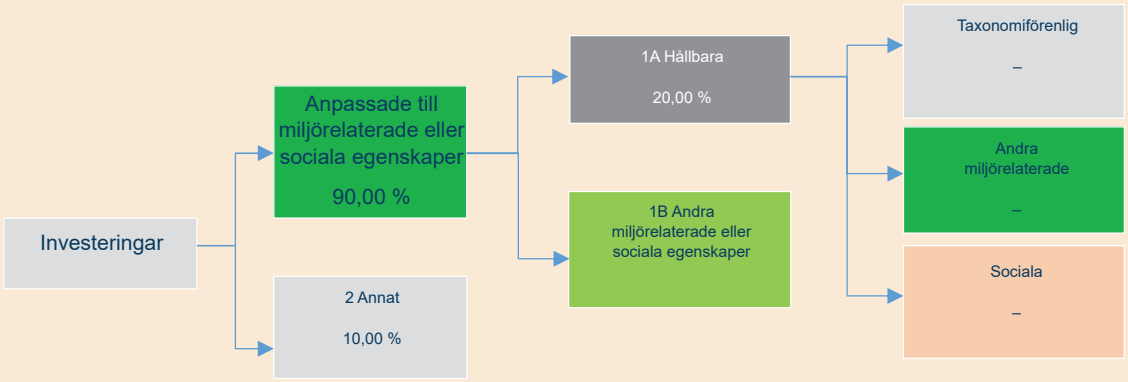
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20,00 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram.
Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

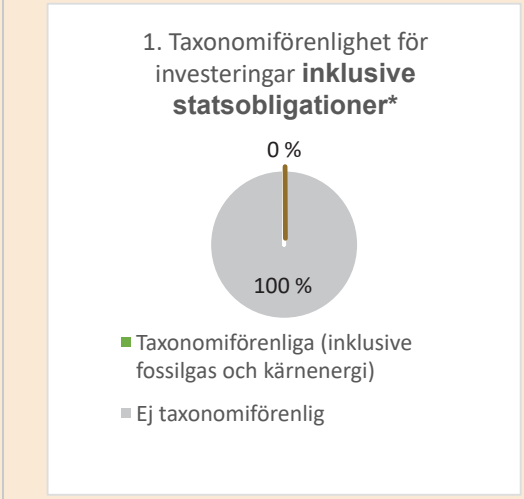
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[80]?

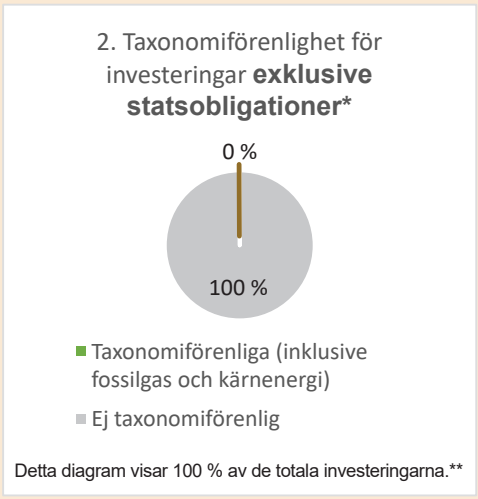
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[80] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI Pacific ex Japan Index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag i 4 av 5 industriländer i Stillahavsområdet undantaget Japan (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI Pacific ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
213800SBLTEAN62APV17

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
   - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
   - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn för hög klimatpåverkan (”High Climate Impact Sector”) är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.

**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

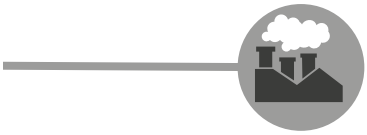
OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt

ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[81].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

[81] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Pacific Index, som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i 5 länder med utvecklade marknader i Stillahavsområdet (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser.

Sedan applicerar MSCI på det kvarvarande investeringsområdet en optimering som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget*** för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning

- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn för hög klimatpåverkan (”High Climate Impact Sector”) är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.

**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

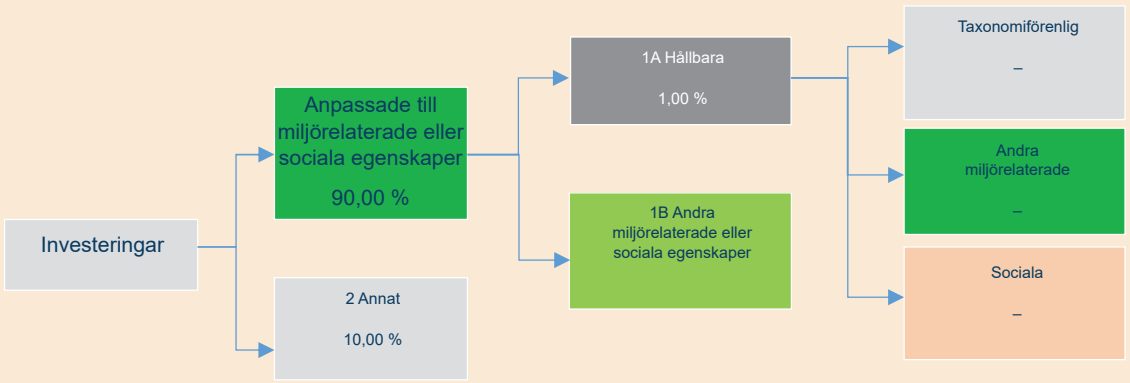
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[82]?***

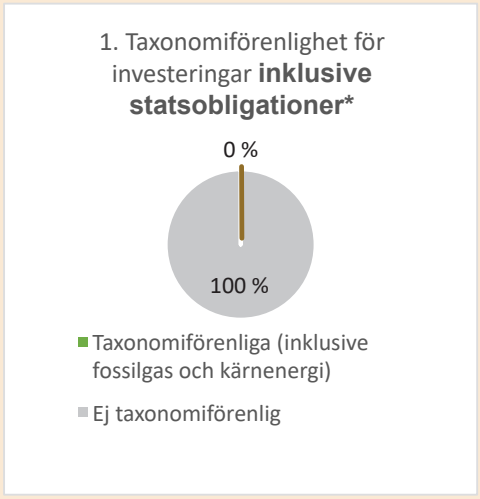
☐ Ja:

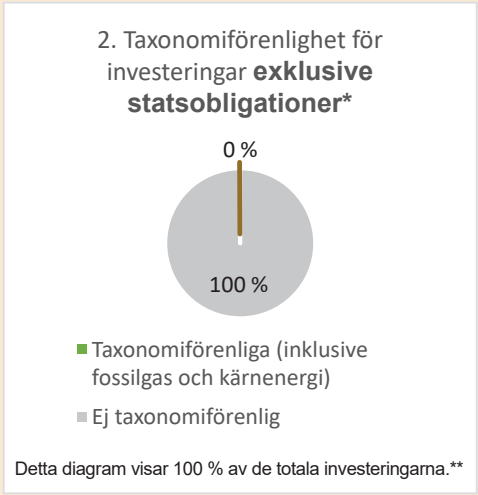
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter ärverksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[82] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Pacific Index, som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i 5 länder med utvecklade marknader i Stillahavsområdet (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI North America ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
2221009K64OHGR1O8Z36

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– en minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %

– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI North America ESG Broad CTB Select Index samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning

   - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet

   - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %

2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.

**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.

– **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.

– **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.

– **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[83].

– **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI North America ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI North America Index, som är representativt för segmenten med stora och medelstora företag på marknaderna i USA och Kanada (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

[83] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI North America ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
   - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet
   - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %.

2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.
*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

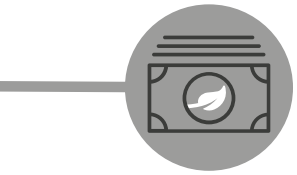
Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

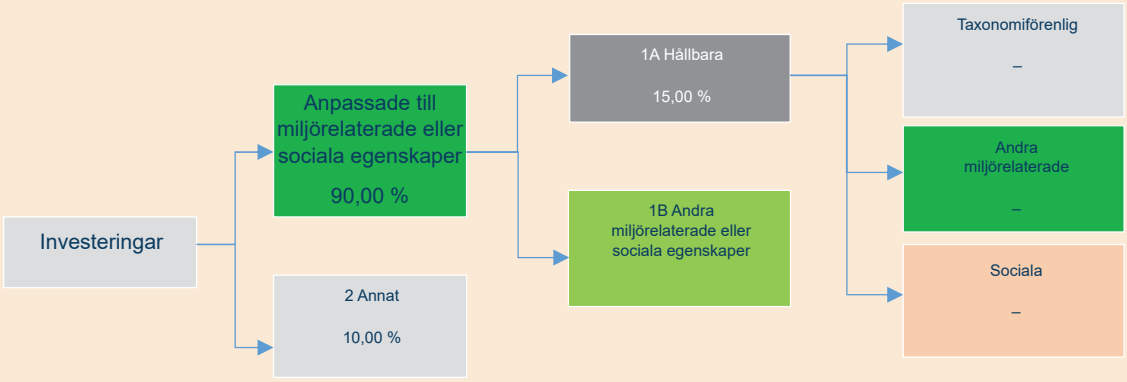
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

På vilket sätt bidrar användningen av derivat till att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

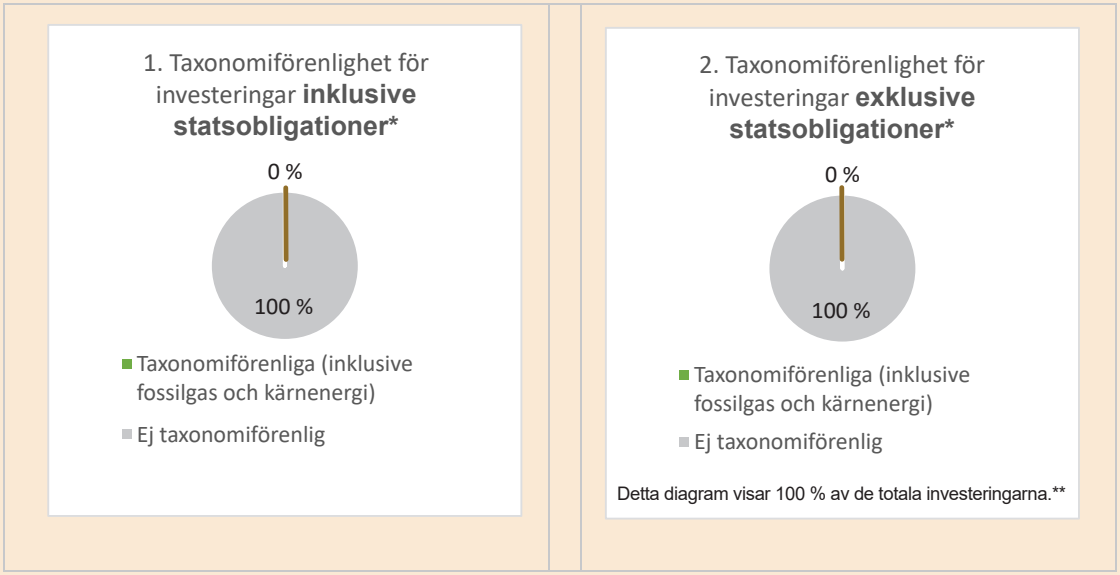
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[84]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[84] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI North America Index, som är representativt för segmenten med stora och medelstora företag på marknaderna i USA och Kanada (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI Japan SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
2138007H5QEZTOGC4B22

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 35,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.
– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI JAPAN SRI Filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

– MSCI ESG-betyg
– aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
– branschjusterade ESG-betyg och minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde. Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:
– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[85].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI JAPAN SRI Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI JAPAN SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Japan Index (”överordnade indexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på den japanska marknaden. Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

[85] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI JAPAN SRI Filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara.

– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:
– överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket – minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet – årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 % – minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

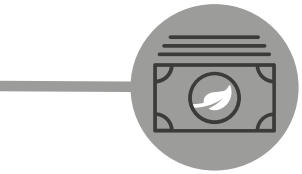
Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju steg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

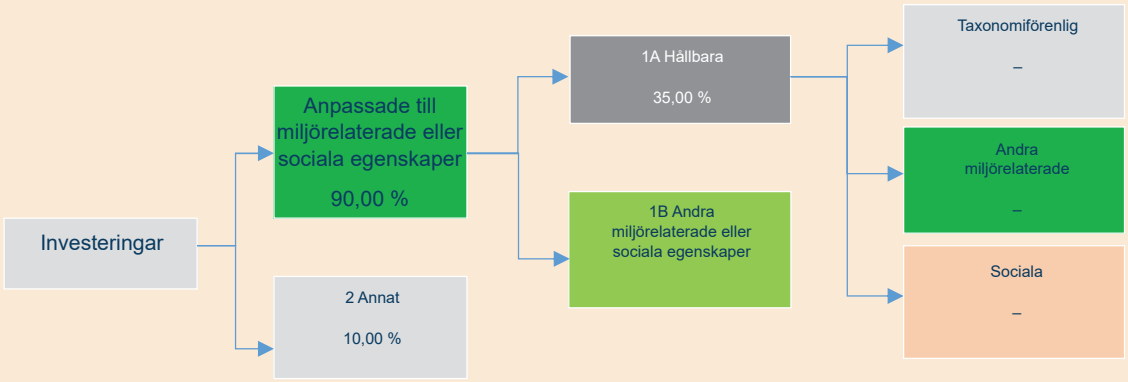
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 35,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[86]?

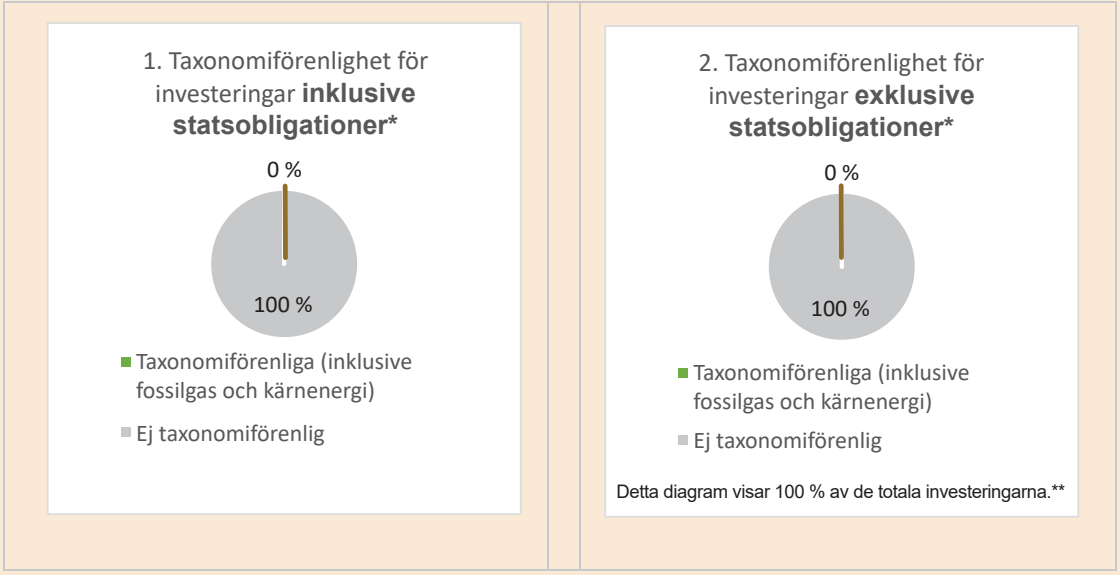
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[86] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

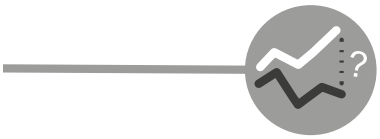
Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 35 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 35 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI Japan SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Japan index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på den japanska marknaden. Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan.

Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI Japan ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
2221000CD5HRISG4GK83

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: _____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

- en minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %
- en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som är involverade i affärsverksamhet enligt MSCI ESG Research*, däribland kärnvapen, tobak, konventionella vapen, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
– minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet
– årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %.

2. Minsta allokering till sektorn för hög klimatpåverkan (”High Climate Impact Sector”) är lika stor som i moderindexet

3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.

**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis

2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

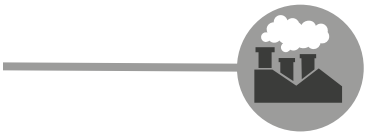
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[87].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[87] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Japan Index (”moderindexet”), som är representativt för segmenten med stora och medelstora företag på den japanska marknaden och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som är involverade i affärsverksamhet enligt MSCI ESG Research*, däribland kärnvapen, tobak, konventionella vapen, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan applicerar MSCI på det kvarvarande investeringsområdet en optimering som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget*** för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
   – minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet
   – årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %.
2. Minsta allokering till sektorn för hög klimatpåverkan (”High Climate Impact Sector”) är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.
*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

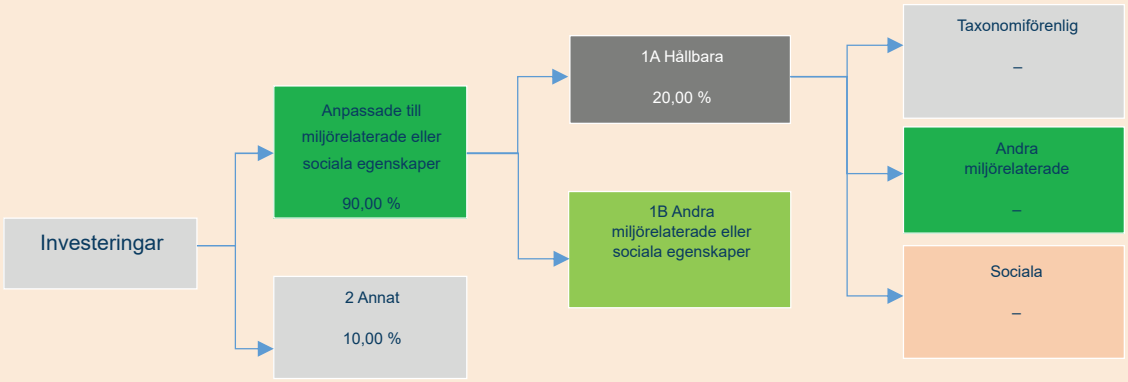
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

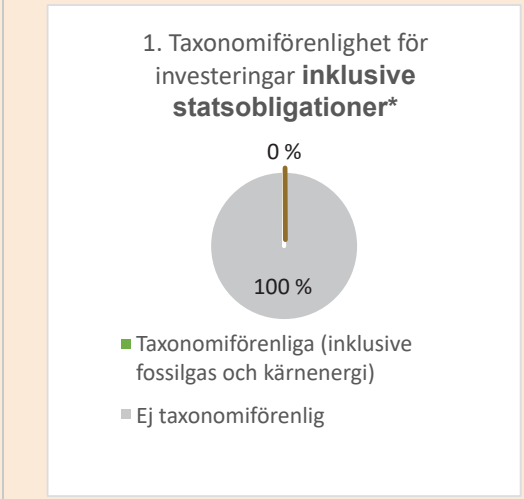
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[88]?***

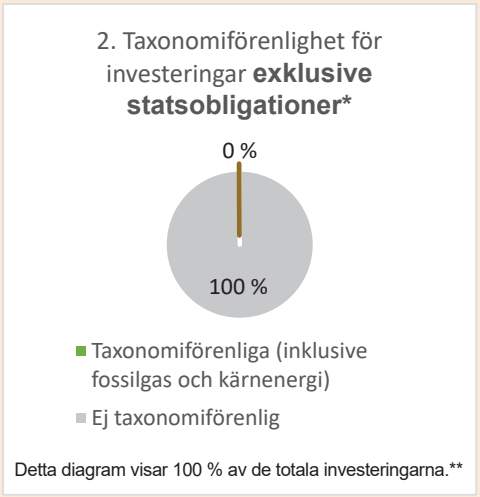
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[88] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Japan Index, som är representativt för segmenten med stora och medelstora företag på den japanska marknaden (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI Europe SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
549300T9XW2XYJW1RS43

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: _____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 40 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

–en minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %
–en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Europe SRI Filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara.

– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):
– MSCI ESG-betyg
– aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
– branschjusterade ESG-betyg och minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.

– **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[89].
– **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Europe SRI Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI Europe SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på 15 utvecklade marknader i Europa (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI Europe SRI Filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

[89] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara.
– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):
– MSCI ESG-betyg
– aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
– branschjusterade ESG-betyg och minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:
– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju steg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

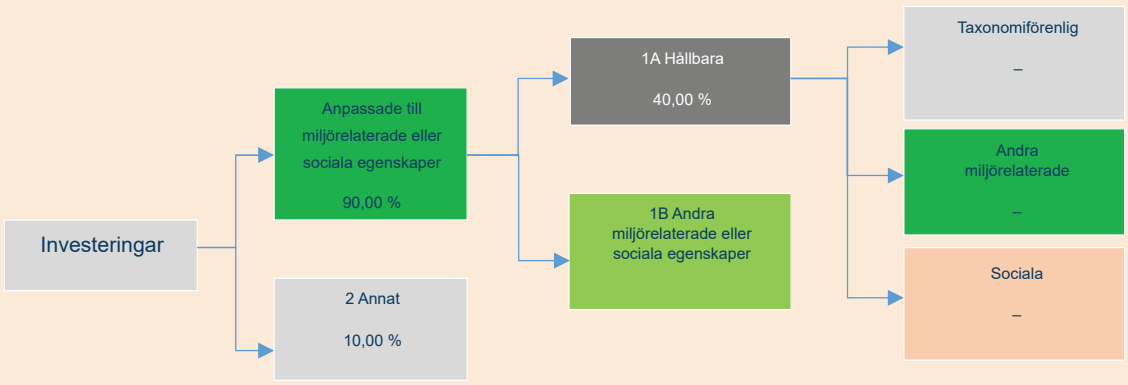
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 40,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas och/eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[90]?

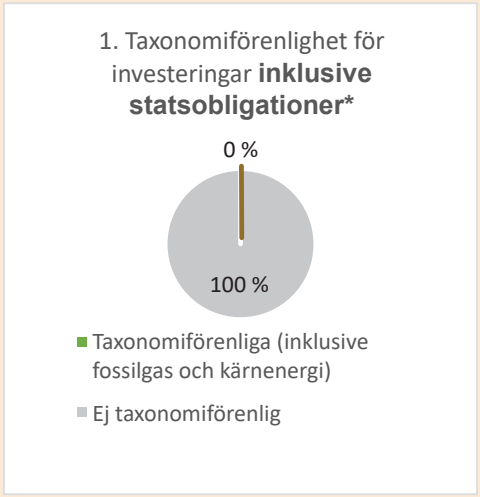
☐ Ja:

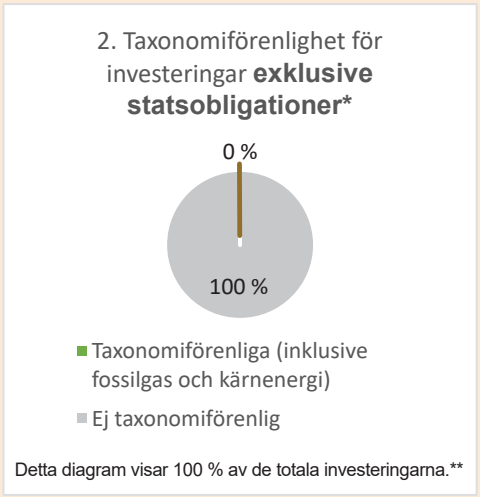
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[90] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.


är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 40 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



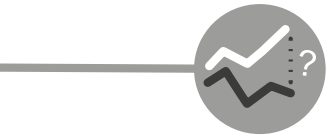
Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 40 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI Europe SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på 15 utvecklade marknader i Europa (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Europe Small Cap ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
213800H5N4JH1FRBT766

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: _____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 30,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn för hög klimatpåverkan (”High Climate Impact Sector”) är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett MSCI ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets MSCI ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.
*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

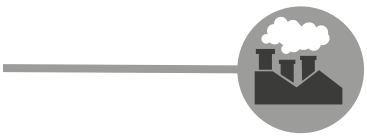
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har även utformats för att beakta viktiga konsekvenser för hållbarhetsfaktorer samt kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[91].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[91] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Small Cap Index som representerar värdepapper i små företag i länder med utvecklade marknader i Europa (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %

2. Minsta allokering till sektorn för hög klimatpåverkan (”High Climate Impact Sector”) är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett MSCI ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

I Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.
*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

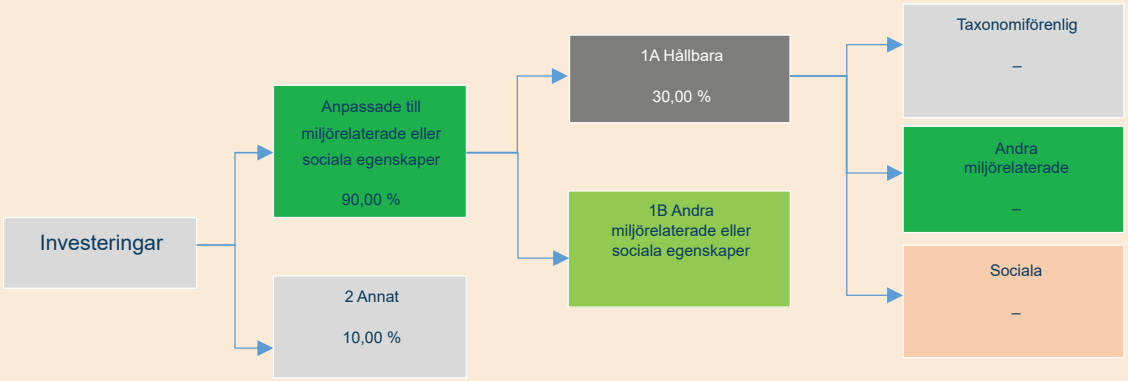
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 30,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

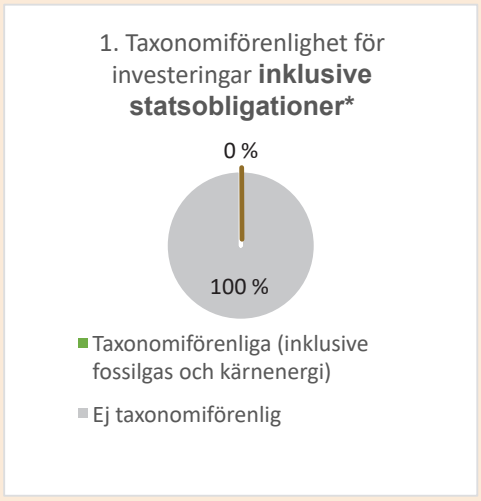
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[92]?***

☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[92] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 30 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 30 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

  Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Small Cap Index, som är representativt värdepapper i små företag i länder med utvecklade marknader i Europa (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
5493009JG8TNRW3XF071

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: _____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 30 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:
– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.
– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

  Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.
  WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.
  Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.
  – Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
  – Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
  – Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

  Närmare bestämt sätts MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.
  För det första utesluts värdepapper i företag som är involverade i affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research, inklusive
  kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.
  Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
  1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
  – minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet
  – årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %.
  2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
  3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

  Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.
***MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte tillämpas på indexmetodens nivå.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier:

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[93].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

[ ] Nej

[93] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe ex Switzerland Index, som är representativt för stora och medelstora aktier i 14 av 15 länder med utvecklade marknader i Europa (med undantag för Schweiz) (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
MSCI Europe ex Switzerland ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.
Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.
Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.
Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.
Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.
Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde. Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

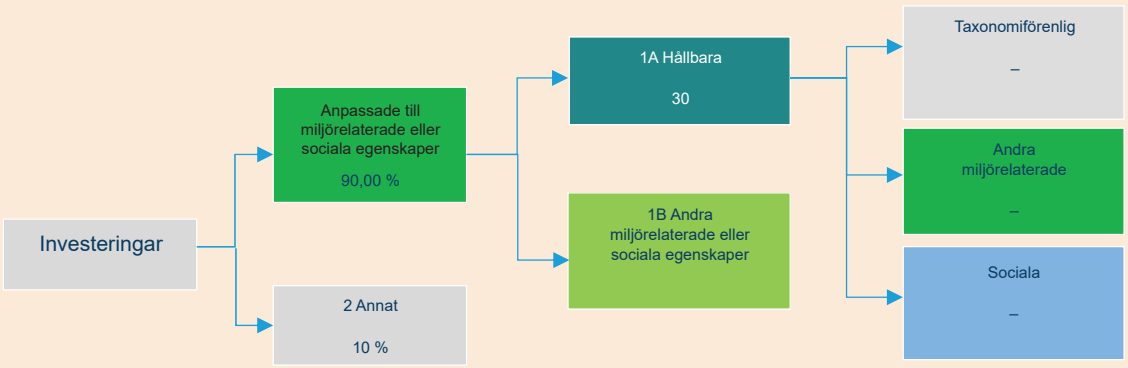
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 30 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

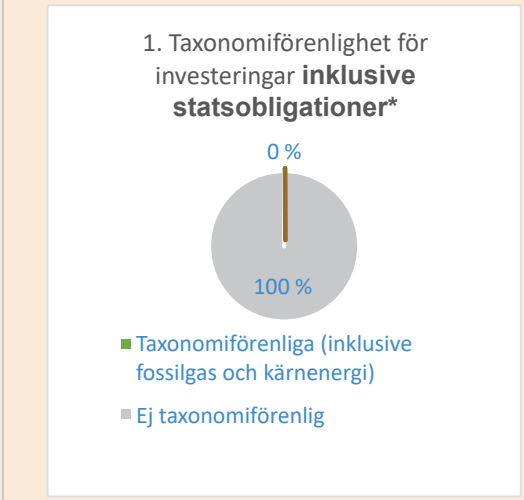
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[94]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[94] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 30 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 30 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Det finns inga lägsta miljömässiga eller sociala garantier.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe ex Switzerland Index, som är representativt för stora och medelstora aktier i 14 av 15 länder med utvecklade marknader i Europa (med undantag för Schweiz) (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på: https://www.msci.com/index-methodology

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Europe ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
5493000LLOOP2JUYI637

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 30,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**



Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:
– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.
– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
    - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
    - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:
Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:
Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☐ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[95].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index, som är representativt för stora och medelstora värdepapper i länder med utvecklade marknader i Europa (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

[95] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
    - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
    - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.
Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

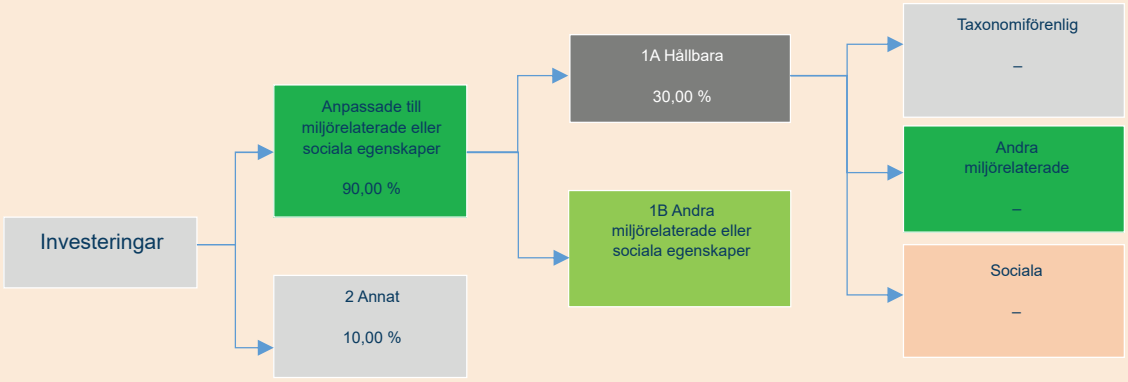
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 30 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

På vilket sätt bidrar användningen av derivat till att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gaseller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[96]?

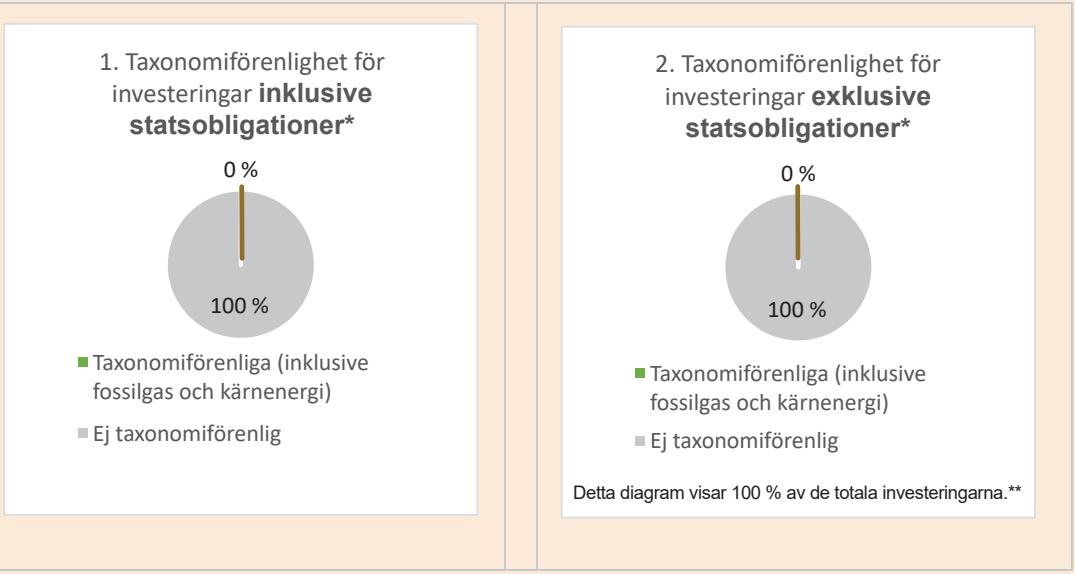
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[96] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 30 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 30 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index, som är representativt för stora och medelstora värdepapper i länder med utvecklade marknader i Europa (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Europe Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
2221005CN7A7XZRQ4W36

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 30,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.
– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.
Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt är MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered PAB Index konstruerat med hjälp av en optimeringsprocess som syftar till att uppnå replikerbarhet och investeringsbarhet.

Först utesluter indexet företag från moderindexet med verksamhet inom kontroversiella vapen, ESG-kontroverser, tobak, miljöskador, kärnvapen, termiskt kol, brytning av termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, arktisk olja och gas samt elproduktion, baserat på MSCI-metoder. En optimeringsprocess används för att fastställa indexets beståndsdelar och deras respektive vikt i indexet. Processen syftar till att minimera den aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt uppnå mål genom optimeringsbegränsningar, inklusive:

1. Mål för omställningsrisk och fysisk risk:
   a. Minsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med moderindexet.
   b. Minsta genomsnittliga minskning (per år) av växthusgasintensiteten med 10 % i förhållande till växthusgasintensiteten vid basdatumet.
   c. Aktiv vikt i sektorn med hög klimatpåverkan som är minst lika stor som moderindexets.
   d. Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i moderindexet.
   e. Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till moderindexet.
   f. Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande till moderindexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:
   a. Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till moderindexet.
   b. Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter och viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen jämfört med moderindexet.
   c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till moderindexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdels aktiva vikt, beståndsdels minsta vikt, värdepappersvikt som en multipel av sin vikt i moderindexet, aktiva sektorvikter och aktiva landsvikter.

Mer information finns i indexmetoden som finns på msci.com.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, kontroversiella vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

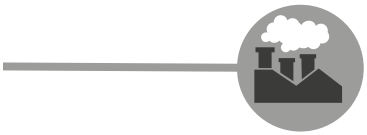
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[97].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[97] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe index, som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på utvecklade marknader inom europeiska ekonomiska och monetära unionen (”moderindexet”). Indexet är utformat för att stödja investerare som vill minska sin exponering mot omställningsrisker och fysiska klimatrisker och som vill eftersträva möjligheter till följd av omställningen till en ekonomi med lägre koldioxidutsläpp samtidigt som de anpassar sig till kraven i Parisavtalet. Indexet innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformade för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered PAB Index är konstruerat med hjälp av en optimeringsprocess som syftar till att uppnå replikerbarhet och investeringsbarhet.

Först utesluter indexet företag från moderindexet med verksamhet inom kontroversiella vapen, ESG-kontroverser, tobak, miljöskador, kärnvapen, termiskt kol, brytning av termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, arktisk olja och gas samt elproduktion, baserat på MSCI-metoder. En optimeringsprocess används för att fastställa indexets beståndsdelar och deras respektive vikt i indexet. Processen syftar till att minimera den aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt uppnå mål genom optimeringsbegränsningar, inklusive:

1. Mål för omställningsrisk och fysisk risk:
   a. Minsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med moderindexet.
   b. Minsta genomsnittliga minskning (per år) av växthusgasintensiteten med 10 % i förhållande till växthusgasintensiteten vid basdatumet.
   c. Aktiv vikt i sektorn med hög klimatpåverkan som är minst lika stor som moderindexets.
   d. Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i moderindexet.
   e. Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till moderindexet.
   f. Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande till moderindexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:
   a. Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till moderindexet.
   b. Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter och viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen jämfört med moderindexet.
   c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till moderindexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdels aktiva vikt, beståndsdels minsta vikt, värdepappersvikt som en multipel av sin vikt i moderindexet, aktiva sektorvikter och aktiva landsvikter.

Mer information finns i indexmetoden som finns på msci.com.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

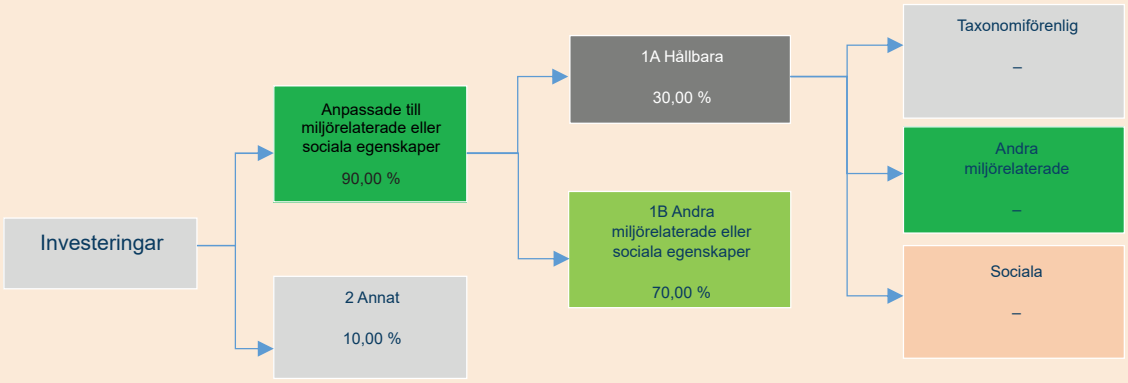
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 35 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

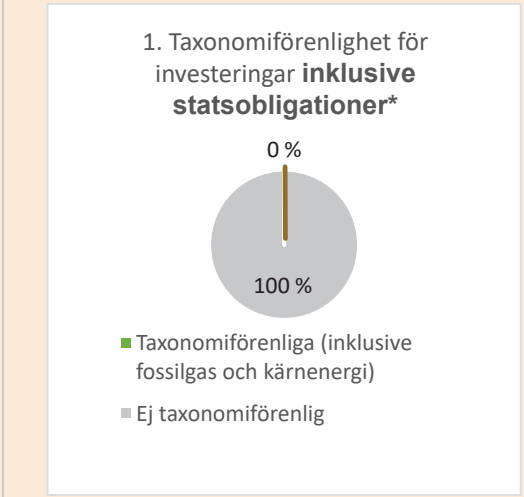
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[98]?

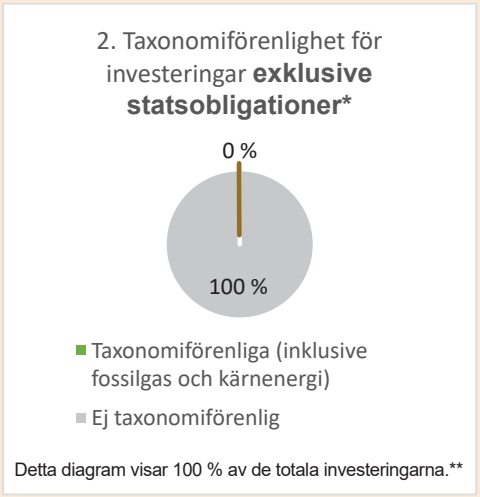
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[98] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 35 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 35 % hållbara investeringar utan något åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index (”moderindexet”), representativt för de stora och mellanstora företagens värdepapper i 15 industriländer i Europa. Indexet är utformat för att stödja investerare som vill minska sin exponering mot omställningsrisker och fysiska klimatrisker och som vill eftersträva möjligheter till följd av omställningen till en ekonomi med lägre koldioxidutsläpp samtidigt som de anpassar sig till kraven i Parisavtalet. Indexet innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformade för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI EMU SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
2138002M8UPUVNSJT429

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [X] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [X] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 40,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.

– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI EMU SRI Filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara.

– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-poäng
- minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

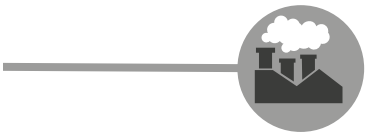
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[99].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[99] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU SRI Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EMU SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU index och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på tio utvecklade marknader inom europeiska ekonomiska och monetära unionen (per november 2021) (”moderindexet”). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EMU SRI Filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

- –företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
- –de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

- –MSCI ESG-betyg
- –aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- –branschjusterade ESG-poäng
- –minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

–överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket – minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet – årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %

–Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

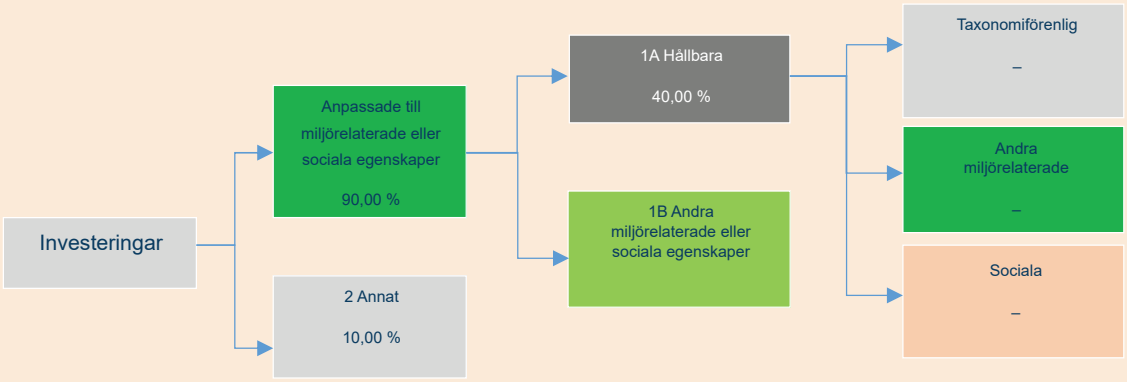
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 40,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper**, omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

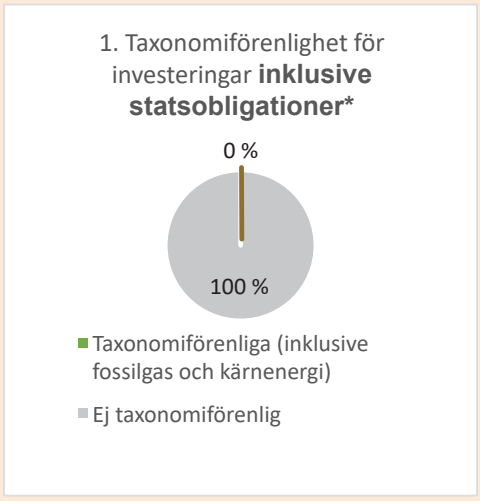
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[100]?***

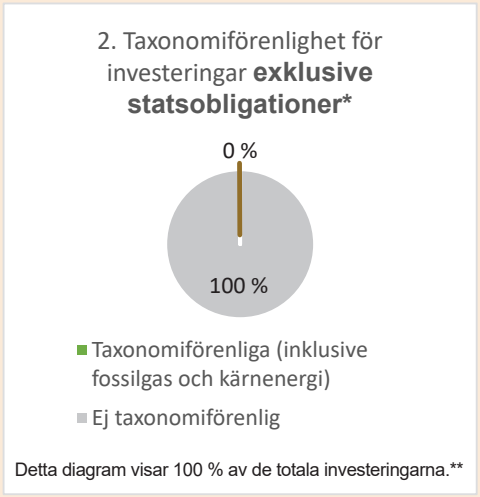
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[100] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 40 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 40 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI EMU SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU index och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på tio utvecklade marknader inom europeiska ekonomiska och monetära unionen (per november 2021) (”moderindexet”).

Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI EMU Small Cap ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
213800EOKXEM989MZ785

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [X] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [X] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 25,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

– en minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Custom Net EUR Index (”indexet”) samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett MSCI ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.
*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.
Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[101].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

[ ] Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Custom Net EUR Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index, som är representativt för stora och medelstora värdepapper i länder med utvecklade marknader i Europa (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

[101] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Custom Net EUR Index (”indexet”) sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

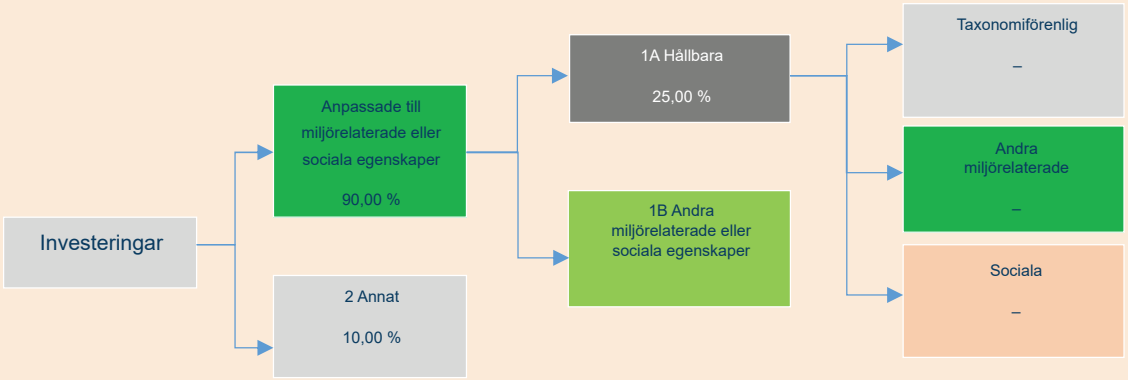
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 25,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[102]?***

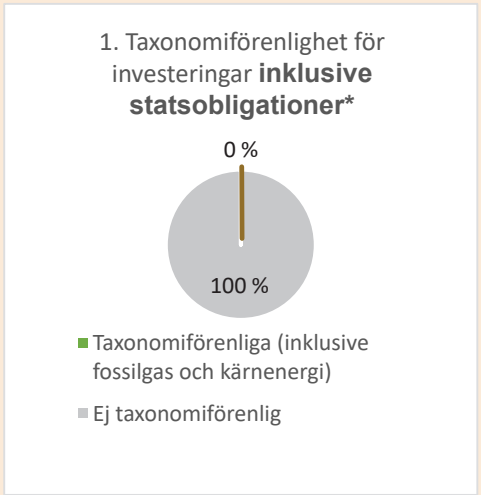
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[102] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 25 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 25 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Small Cap Index, som är representativt för värdepapper i små företag i utvecklade länder som ingår i Europeiska ekonomiska och monetära unionen (”EMU”) (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology.



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com.

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI EMU ESG Selection

Identifieringskod för juridiska personer:
2221007ZZU8XN39KWS32

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [X] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [X] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 30,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:

https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:

https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI EMU Index, genom att:
1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol och okonventionell olja och gas.

2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
– Företag som inte är befintliga beståndsdelar i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.
– De företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis

2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[103].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 10 utvecklade länder (per september 2020) i Ekonomiska och monetära unionen (EMU) emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

[103] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI EMU Index, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.

2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– Företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.

– De företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

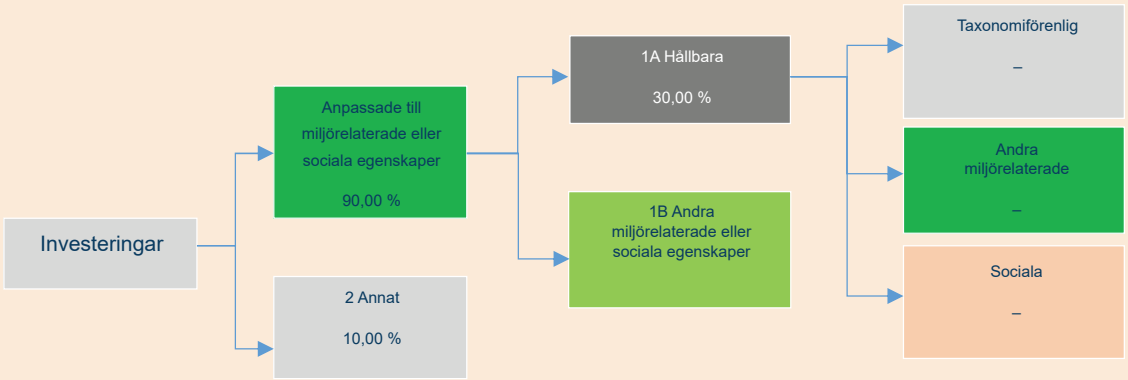
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 30,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[104]?***

☐ Ja:

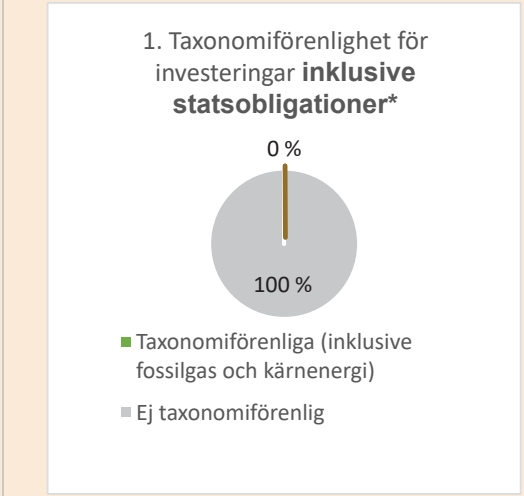
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

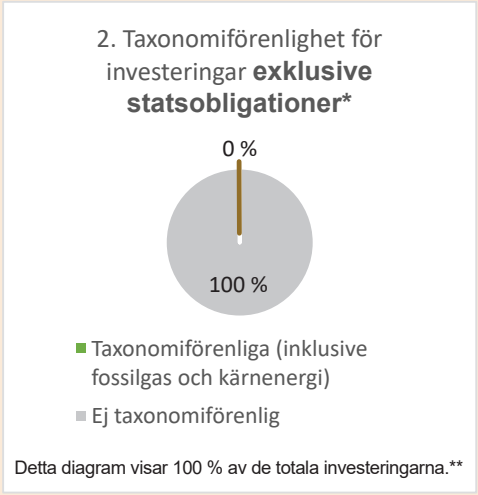
☒ Nej

[104] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 30 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 30 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI EMU ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index (”moderindexet”), som är representativt för stora och medelstora företag i 10 industriländer (per september 2020) inom EMU och emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI EMU ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
213800BXN74KCDO6QM33

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 35,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO_2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.
Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI EMU ESG Broad CTB Select Net Total Return Index (”indexet”) samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
   - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
   - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer. Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt.

För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn). Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak. Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[105].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

[ ] Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU ESG Broad CTB Select Net Total Return Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index, som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i utvecklade länder som ingår i Europeiska ekonomiska och monetära unionen (”EMU”) (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

[105] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI EMU ESG Broad CTB Select Net Total Return Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
    - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
    - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

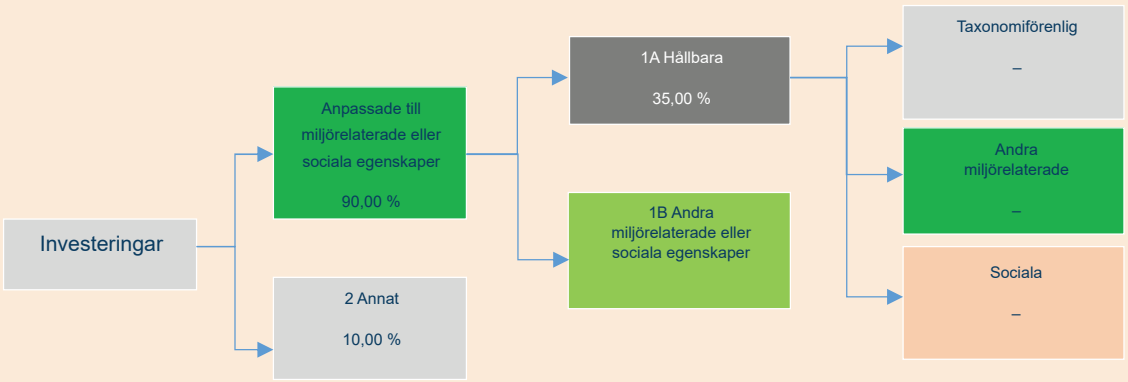
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 35,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[106]?***

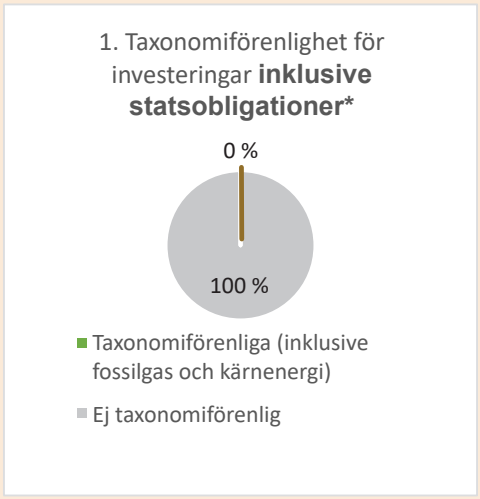
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[106] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

 är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 35 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 35 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index, som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i utvecklade länder som ingår i Europeiska ekonomiska och monetära unionen (”EMU”) (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI EMU Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
2138007S1QFFN8UYKB61

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ●● ☐ **Ja**
- ●○ ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 35,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:
– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.
– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter.

Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt är MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered PAB Index konstruerat med hjälp av en optimeringsprocess som syftar till att uppnå replikerbarhet och investeringsbarhet.

Först utesluter indexet företag från moderindexet med verksamhet inom kontroversiella vapen, ESG-kontroverser, tobak, miljöskador, kärnvapen, termiskt kol, brytning av termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, arktisk olja och gas samt elproduktion, baserat på MSCI-metoder. En optimeringsprocess används för att fastställa indexets beståndsdelar och deras respektive vikt i indexet. Processen syftar till att minimera den aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt uppnå mål genom optimeringsbegränsningar, inklusive:

1. Mål för omställningsrisk och fysisk risk:

    a. Minsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med moderindexet.

    b. Minsta genomsnittliga minskning (per år) av växthusgasintensiteten med 10 % i förhållande till växthusgasintensiteten vid basdatumet.

    c. Aktiv vikt i sektorn med hög klimatpåverkan som är minst lika stor som moderindexets.

    d. Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i moderindexet.

    e. Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till moderindexet.

    f. Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande till moderindexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:

    a. Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till moderindexet.

    b. Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter och viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen jämfört med moderindexet.

    c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till moderindexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdels aktiva vikt, beståndsdels minsta vikt, värdepappersvikt som en multipel av sin vikt i moderindexet, aktiva sektorvikter och aktiva landsvikter.

Mer information finns i indexmetoden som finns på msci.com.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, kontroversiella vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut som har mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

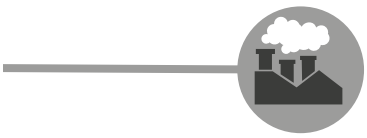
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[107].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[107] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI EMU index som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på utvecklade marknader inom europeiska ekonomiska och monetära unionen (”moderindexet”). Indexet är utformat för att stödja investerare som vill minska sin exponering mot omställningsrisker och fysiska klimatrisker och som vill eftersträva möjligheter till följd av omställningen till en ekonomi med lägre koldioxidutsläpp samtidigt som de anpassar sig till kraven i Parisavtalet.

Indexen innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformade för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered PAB Index är konstruerat med hjälp av en optimeringsprocess som syftar till att uppnå replikerbarhet och investeringsbarhet.

Först utesluter indexet företag från moderindexet med verksamhet inom kontroversiella vapen, ESG-kontroverser, tobak, miljöskador, kärnvapen, termiskt kol, brytning av termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, arktisk olja och gas samt elproduktion, baserat på MSCI-metoder. En optimeringsprocess används för att fastställa indexets beståndsdelar och deras respektive vikt i indexet. Processen syftar till att minimera den aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt uppnå mål genom optimeringsbegränsningar, inklusive:

1. Mål för omställningsrisk och fysisk risk:

   a. Minsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med moderindexet.

   b. Minsta genomsnittliga minskning (per år) av växthusgasintensiteten med 10 % i förhållande till växthusgasintensiteten vid basdatumet.

   c. Aktiv vikt i sektorn med hög klimatpåverkan som är minst lika stor som moderindexets.

   d. Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i moderindexet.

   e. Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till moderindexet.

f. Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande till moderindexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:

   a. Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till moderindexet.

   b. Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter och viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen jämfört med moderindexet.

   c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till moderindexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdels aktiva vikt, beståndsdels minsta vikt, värdepappersvikt som en multipel av sin vikt i moderindexet, aktiva sektorvikter och aktiva landsvikter. Mer information finns i indexmetoden som finns på msci.com.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

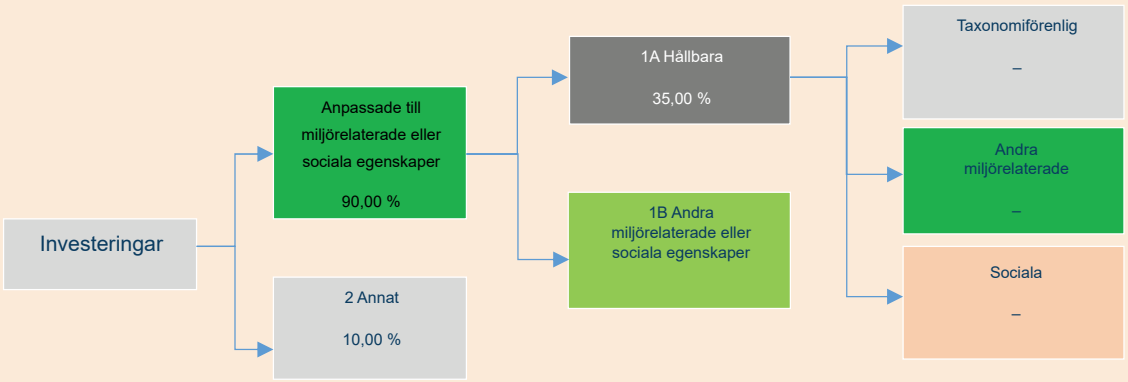
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 35 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[108]?

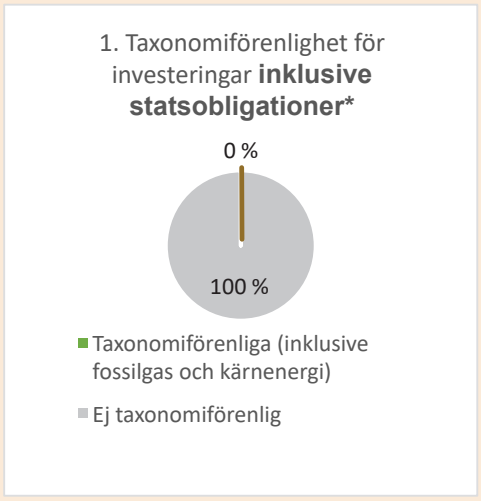
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[108] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 35 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 35 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI EMU index som är representativt för aktier i stora och medelstora företag på utvecklade marknader inom europeiska ekonomiska och monetära unionen (”moderindexet”). Indexet är utformat för att stödja investerare som vill minska sin exponering mot omställningsrisker och fysiska klimatrisker och som vill eftersträva möjligheter till följd av omställningen till en ekonomi med lägre koldioxidutsläpp samtidigt som de anpassar sig till kraven i Parisavtalet. Indexen innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformade för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI Emerging Markets SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
549300GISPIIUMKTYR80

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.

– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

- Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
- Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
- Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

- företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
- de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper i företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-betyg och minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

- Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
- Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter?

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[109].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Parisavtalet (EU PAB).

[109] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI Emerging Markets SRI filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara.
– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.
– årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper i företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet. Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

– MSCI ESG-betyg
– aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
– branschjusterade ESG-betyg och minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
– Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

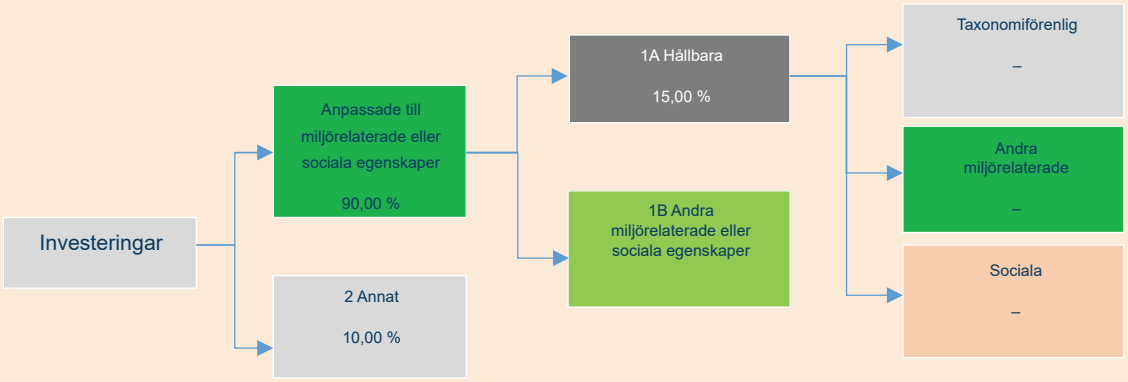
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

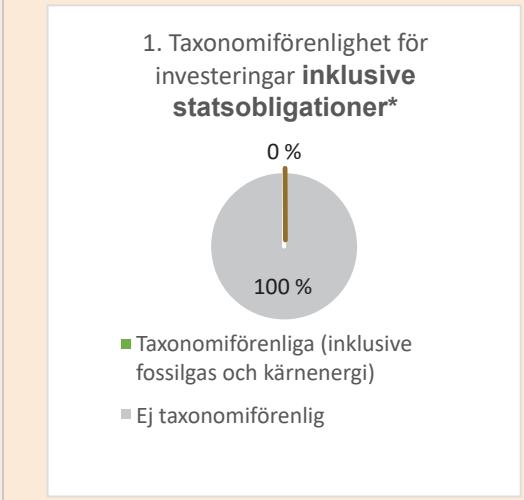
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[110]?***

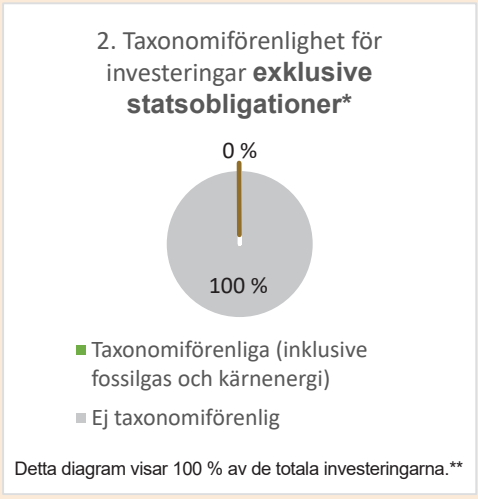
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[110] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets Index (”moderindexet”), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Parisavtalet (EU PAB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
213800T33RUUA8EO4L57

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [x] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [x] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.
– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
   - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
   - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 1 % I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla släpper MSCI på begränsningarna och ökar särskilt den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.

**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

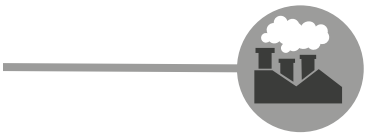
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[111].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[111] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index, som är representativt för marknader för stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021) (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index (”indexet”) sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:

1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
   - minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
   - årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.

***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

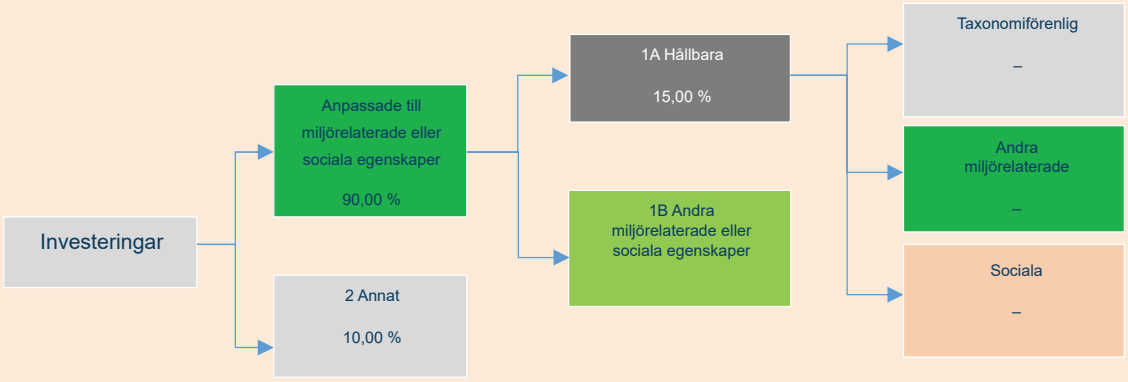
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[112]?

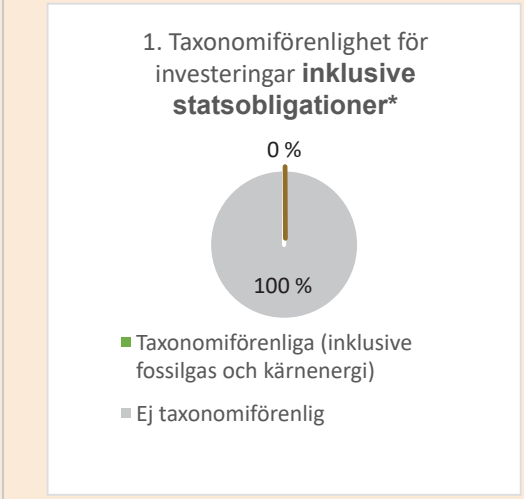
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

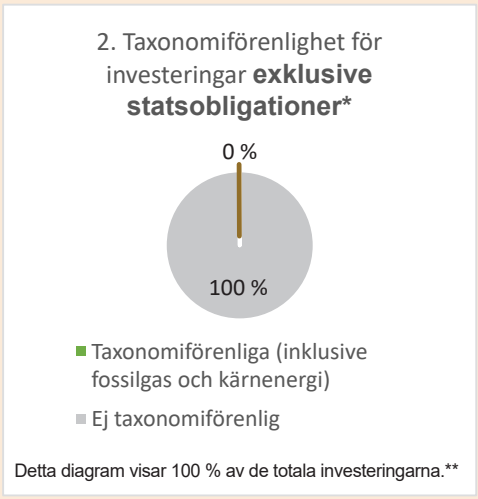
[112] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index, som är representativt för marknader för stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021) (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Emerging Ex China ESG Selection

Identifieringskod för juridiska personer:
213800J6GAIQJ1OPP251

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EM ex China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) alla värdepapper i moderindexet. Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i moderindexet, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.
2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.
   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.
3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[113].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EM ex China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. MSCI EM ex China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets ex China Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 26 av de 27 tillväxtmarknadsländerna (per januari 2021) utom Kina emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

[113] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EM ex China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”)
omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i moderindexet, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.
2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.
   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.
3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

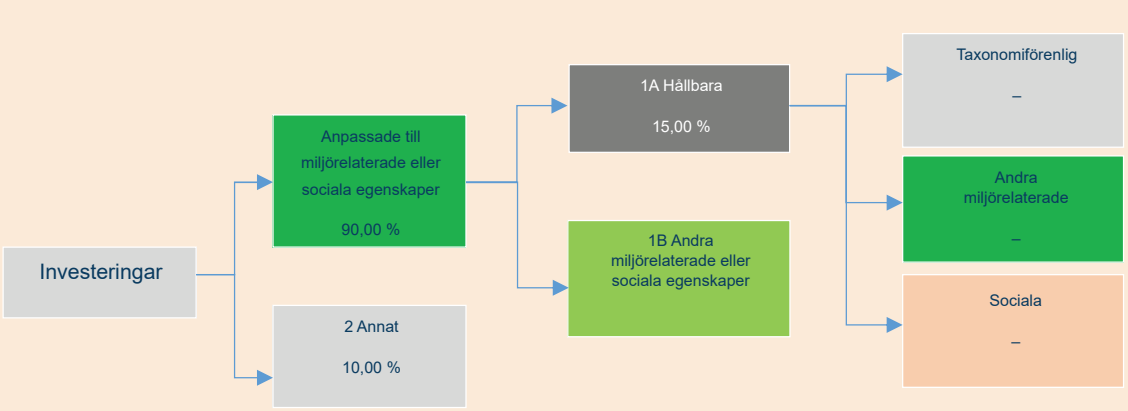
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[114]?***

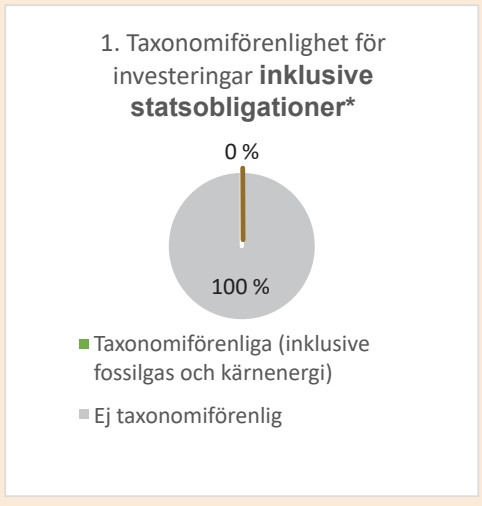
☐ Ja:

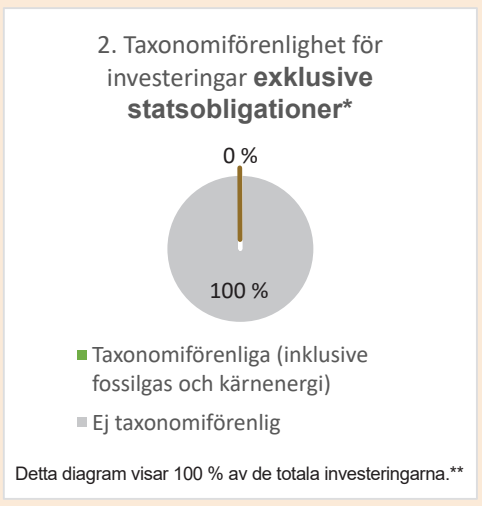
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[114] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets ex China Index (”moderindexet”), representativt för aktier i stora och medelstora bolag i 26 av de 27 tillväxtländerna (per januari 2021), med Kina undantaget, och emitterade av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Emerging Markets ESG Selection

Identifieringskod för juridiska personer:
213800CMYD4SG29DTC94

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 10,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen.

Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EM ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) alla värdepapper i moderindexet. Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI Emerging Markets Index, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.

2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.

   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[115].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[115] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonderna följer resultatet för MSCI EM ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EM ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper från stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021) emitterade av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EM ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) omfattar alla värdepapper i moderindexet. Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI Emerging Markets Index, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.

2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.

   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

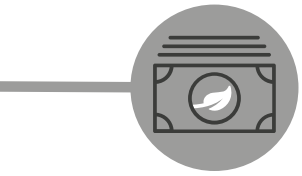
- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

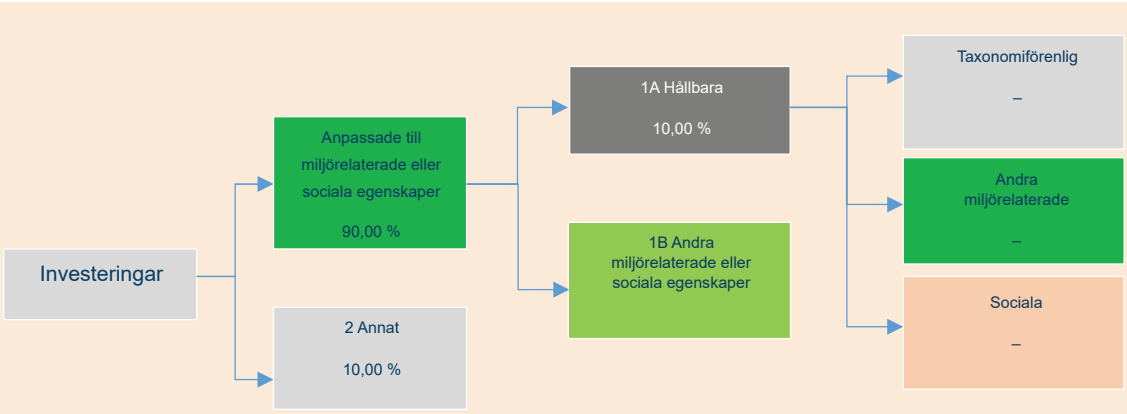
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 10,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[116]?***

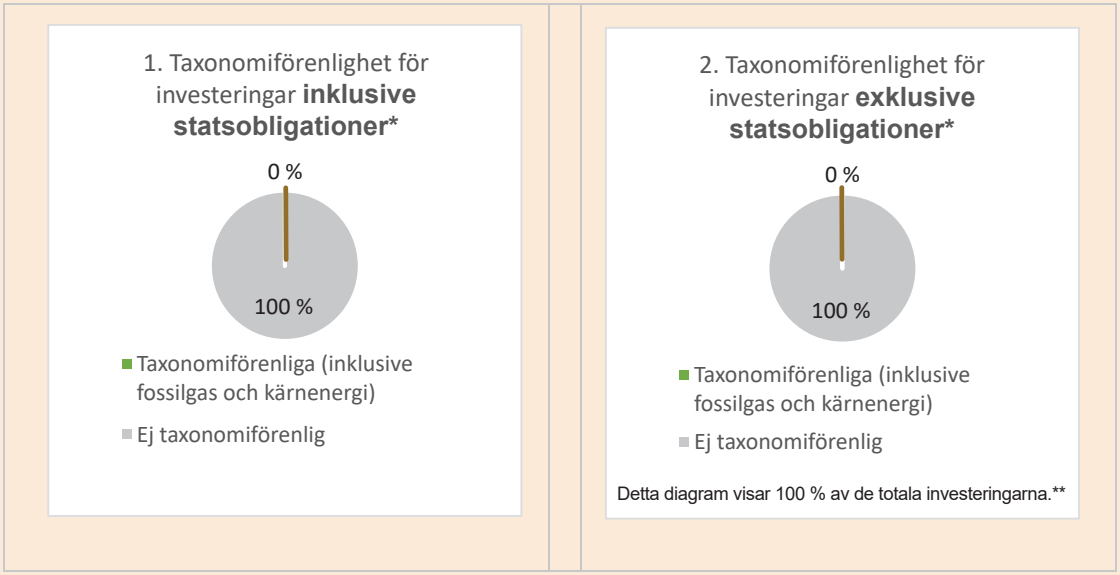
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[116] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 10 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 10 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI Emerging Markets ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets Index (”moderindexet”), som är representativt för värdepapper i de stora och medelstora företagen i 27 tillväxtländer (per november 2021) som har emitterats av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI EM Asia SRI Climate Paris Aligned

Identifieringskod för juridiska personer:
213800XKAFV6VIB4O832

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011. Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för ”EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet” som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 50 %.

– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.

– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.

– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI EM Asia SRI filtered PAB Index (”indexet”) samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning.

De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

– företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara.

– de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på eller över BB och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på eller över 1 för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

– MSCI ESG-betyg

– aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)

– branschjusterade ESG-betyg och minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

– Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %

– Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter?

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[117].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[117] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EM Asia SRI filtered PAB Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EM Asia SRI filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets (EM) (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i nio asiatiska tillväxtmarknadsländer (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI EM Asia SRI filtered PAB Index (”indexet”) sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess på företag som är bäst i klassen i moderindexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

Först utesluts värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamheter som kärnkraft, tobak, alkohol, hasardspel, kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, olja och gas, termiskt kol, fossila bränslereserver, genetiskt modifierade organismer (GMO) och vuxenunderhållning. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:

- företag som inte redan ingår i MSCI SRI Filtered PAB-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på A eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 4 eller högre för att vara godtagbara
- de företag som för närvarande ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BB eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på 1 eller högre för att förbli godtagbara.

En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Indexet eftersträvar sektorsviktningar som överensstämmer med det överordnade indexets. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 25 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Aktier rangordnas efter följande kriterier (i ordning):

- MSCI ESG-betyg
- aktuellt indexmedlemskap (befintliga beståndsdelar föredras framför icke-beståndsdelar)
- branschjusterade ESG-betyg och minskat justerat fritt omsättningsbart börsvärde.

Aktier i företag som har drabbats av mycket allvarliga och allvarliga kontroverser som rör miljöfrågor enligt MSCI utesluts. På det återstående investeringsområdet tillämpar MSCI en optimering som syftar till att särskilt uppfylla följande begränsningar:

- Överensstämmelse med minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet om minskning av koldioxidavtrycket Minskning av koldioxidavtrycket med 50 % jämfört med moderindexet Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
- Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

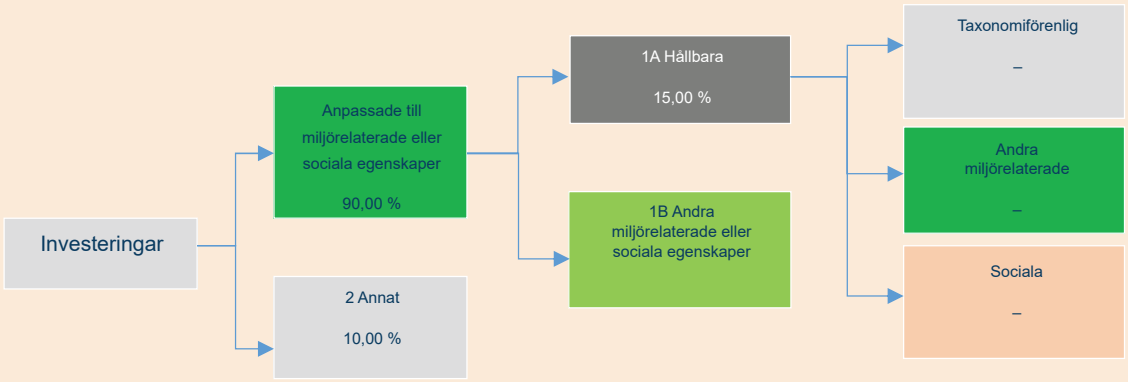
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

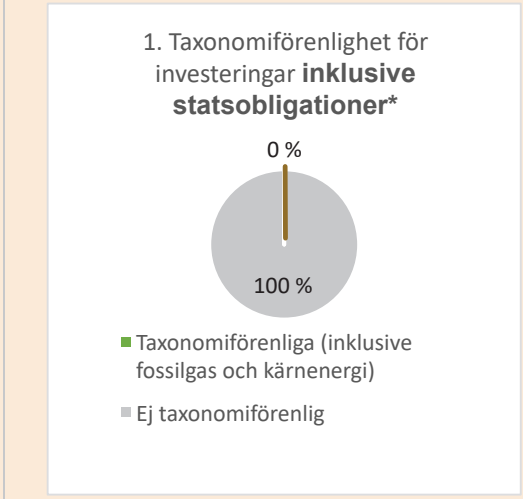
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[118]?***

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[118] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

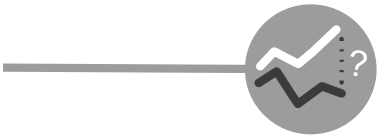
Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI EM Asia SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets (EM) (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i nio asiatiska tillväxtmarknadsländer (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har anmärkningsvärt höga betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Parisavtalet (EU PAB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI EM Asia ESG Broad Transition

Identifieringskod för juridiska personer:
213800X25VEVKDSCYO57

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 10,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som uppfyller minimistandarderna för EU-referensvärden för klimatomställning enligt förordning (EU) 2019/2089 om ändring av förordning (EU) 2016/1011.

Lagen föreslår definitioner av minimistandarder för metoden för EU-referensvärden för klimatomställning som skulle vara anpassade till målen i Parisavtalet. Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:

– En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

– En minsta egen koldioxidminskningsgrad för växthusgasintensiteten i enlighet med den utveckling som det mest ambitiösa scenariot på 1,5 °C från den mellanstatliga panelen för klimatförändringar (IPCC) medför, motsvarande minst 7 % minskning av växthusgasintensiteten i genomsnitt per år.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den viktade genomsnittliga växthusgasintensiteten (”WACI”) används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. WACI är det viktade genomsnittet av indexkomponenternas utsläpp av växthusgaser (uttryckt i t CO2) dividerat med företagsvärdet inklusive kontanter. Utsläppen av växthusgaser är indelade i scope 1-, scope 2- och scope 3-utsläpp.

– Scope 1-utsläpp: utsläpp från källor som ägs eller kontrolleras av företaget.
– Scope 2-utsläpp: utsläpp som orsakas av den produktion av el som köps av företaget.
– Scope 3-utsläpp: inkluderar alla andra indirekta utsläpp som förekommer i ett företags värdekedja.

Närmare bestämt sätts MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Net USD Index (”indexet”) samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att minimera den förväntade aktiva risken i förhållande till moderindexet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
- årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1. följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2. undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

– Det första filtret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak.

Dessutom anses företag och ekonomiska aktörer som exponeras för allvarliga kontroverser i samband med arbetsvillkor, mänskliga rättigheter, biologisk mångfald och föroreningar inte vara hållbara investeringar.

– Det andra filtret syftar till att verifiera att ett investeringsbolag inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Hos Amundi har indikatorerna för negativa konsekvenser beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Hos Amundi är OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[119].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Net USD Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EM Asia Index, som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i länder med tillväxtmarknader i Asien (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

[119] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Net USD Index (”indexet”) sätts samman genom tillämpning av en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess som minimerar den förväntade aktiva risken jämfört med moderindexet och samtidigt säkerställer att indexets ESG-betyg minst motsvarar moderindexets ESG-betyg samt syftar till att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden (EU CTB) för klimatomställning och samtidigt eftersträvar en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt affärsverksamhet som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrning i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser och ”orange flagg” gällande miljökontroverser.

Sedan tillämpar MSCI en optimering på det kvarvarande investeringsområdet som syftar till att maximera det genomsnittliga MSCI ESG-betyget för investeringsområdet samtidigt som följande begränsningar uppfylls:
1. Överensstämmelse med minimikraven gällande minskning av koldioxidavtrycket i EU:s CTB-förordning
– Minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det överordnade indexet
– Årlig minskning av koldioxidavtrycket med 7 %
2. Minsta allokering till sektorn med hög klimatpåverkan är lika stor som i moderindexet
3. Målet är ett ESG-betyg som minst motsvarar moderindexets ESG-betyg.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
***MSCI ESG-betyg ger analyser och värderingar av hur väl företag hanterar risker och möjligheter som rör miljö, sociala frågor och bolagsstyrning.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

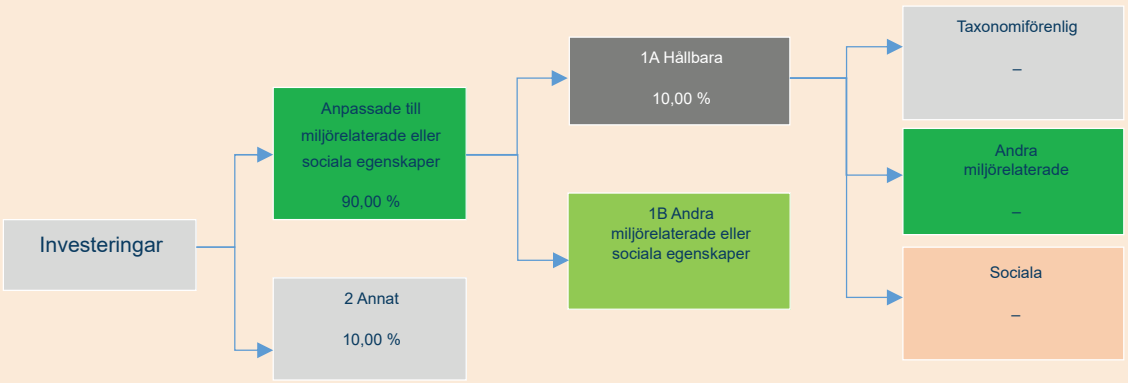
– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 10,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[120]?***

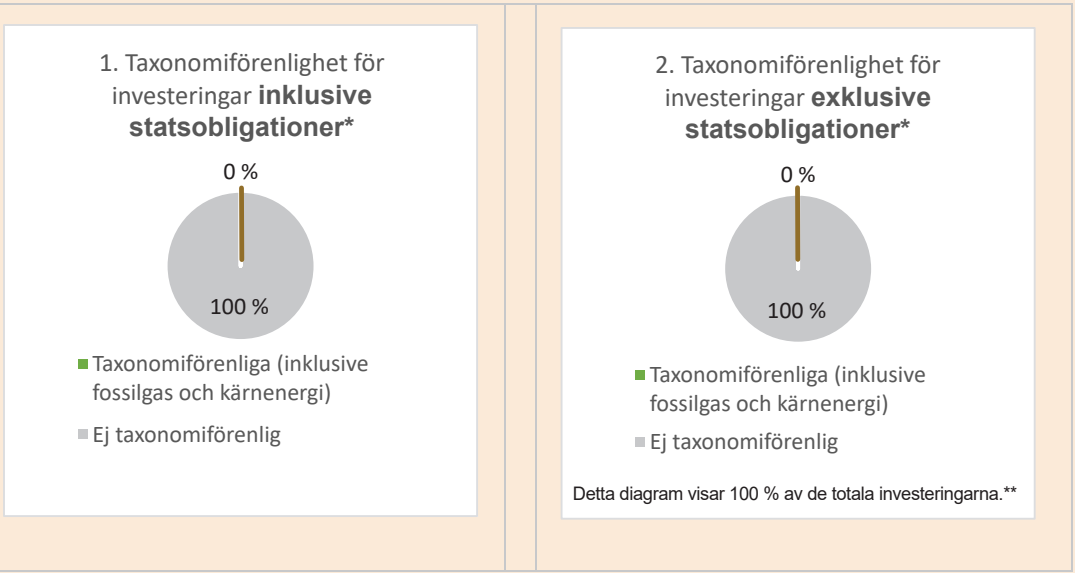
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[120] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.


är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 10 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 10 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga. Det finns inga lägsta miljömässiga eller sociala garantier.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EM Asia Index, som är representativt för värdepapper i stora och medelstora företag i länder med tillväxtmarknader i Asien (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på sociala och miljörelaterade kriterier. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktar om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på: www.MSCI.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI China Tech

Identifieringskod för juridiska personer:
549300LYZ55LWKOSOL45

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt konstrueras indexets godtagbara investeringsområde genom att välja alla värdepapper från MSCI China Investable Market Index (IMI) (moderindex) som har ett relevansbetyg på 25 % eller mer.

För att fastställa det godtagbara investeringsområdet tillämpas ytterligare filtrering enligt nedan.

1. Värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt verksamhet som kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, kärnvapen, tobak, termiskt kol, okonventionell olja och gas, arktisk olja och gas, oljesand och företag som bryter mot FN:s Global Compact utesluts från det godtagbara investeringsområdet.

2. Företag med en ”röd flagg” som MSCI ESG-kontroversbetyg, som mäter en emittents inblandning i mycket allvarliga kontroverser enligt definitionen av MSCI ESG-kontroversmetod utesluts från det godtagbara investeringsområdet.

3. Företag som inte har fått ett MSCI ESG-betyg**** av MSCI ESG Research utesluts från det godtagbara investeringsområdet.

4. Värdepapper som har ett 3-månaders genomsnittligt dagligt handelsvärde (3M ADTV) som är mindre än 3 miljoner USD eller har ett fritt omsättningsbart börsvärde på mindre än 200 miljoner USD utesluts från det godtagbara investeringsområdet. Det filtrerade investeringsområdet konstrueras genom att utesluta värdepapper från det godtagbara investeringsområdet som är i den nedre kvartilen efter branschjusterade ESG-betyg. Värdepapper i det filtrerade investeringsområdet rangordnas i fallande ordning efter sitt relevansbetyg. Om flera värdepapper har samma relevansbetyg får det värdepapper som har högre justerat fritt omsättningsbart börsvärde en högre rangordning. De främsta ”N” värdepapperen från det rangordnade investeringsområdet väljs ut för att tas med i indexet. Om antalet värdepapper i investeringsområdet är under 100, väljs alla värdepapper i det rangordnade investeringsområdet ut för att tas med i indexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

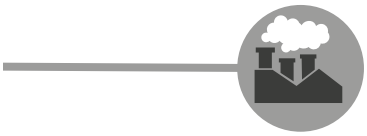
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



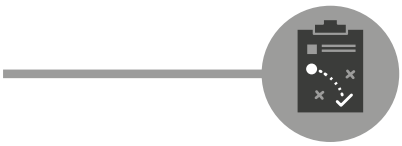
Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[121].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect Filtered Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect Filtered Index strävar efter att representera resultatet för företag som är förknippade med utvecklingen av nya produkter och tjänster från tekniska innovationer som leder till genombrott inom områden som internet och digitalisering, mobilitet, autonom teknik, industriell automatisering och digital hälso- och sjukvård samtidigt som det utesluter företag som är involverade i vissa kontroversiella affärsverksamheter eller har relativt låga MSCI ESG-kontroversbetyg eller MSCI ESG-betyg.

[121] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
Indexets godtagbara investeringsområde konstrueras genom att välja alla värdepapper från MSCI China Investable Market Index (IMI) (moderindexet) som har ett relevansbetyg på 25 % eller mer.

För att fastställa det godtagbara investeringsområdet tillämpas ytterligare filtrering enligt nedan.

1. Värdepapper i företag som enligt MSCI ESG Research ägnar sig åt verksamhet som kontroversiella vapen, konventionella vapen, civila skjutvapen, kärnvapen, tobak, termiskt kol, okonventionell olja och gas, arktisk olja och gas, oljesand och företag som bryter mot FN:s Global Compact utesluts från det godtagbara investeringsområdet.

2. Företag med en ”röd flagg” som MSCI ESG-kontroversbetyg, som mäter en emittents inblandning i mycket allvarliga kontroverser enligt definitionen av MSCI ESG-kontroversmetod utesluts från det godtagbara investeringsområdet.

3. Företag som inte har fått ett MSCI ESG-betyg**** av MSCI ESG Research utesluts från det godtagbara investeringsområdet.

4. Värdepapper som har ett 3-månaders genomsnittligt dagligt handelsvärde (3M ADTV) som är mindre än 3 miljoner USD eller har ett fritt omsättningsbart börsvärde på mindre än 200 miljoner USD utesluts från det godtagbara investeringsområdet. Det filtrerade investeringsområdet konstrueras genom att utesluta värdepapper från det godtagbara investeringsområdet som är i den nedre kvartilen efter branschjusterade ESG-betyg. Värdepapper i det filtrerade investeringsområdet rangordnas i fallande ordning efter sitt relevansbetyg. Om flera värdepapper har samma relevansbetyg får det värdepapper som har högre justerat fritt omsättningsbart börsvärde en högre rangordning. De främsta ”N” värdepapperen från det rangordnade investeringsområdet väljs ut för att tas med i indexet. Om antalet värdepapper i investeringsområdet är under 100, väljs alla värdepapper i det rangordnade investeringsområdet ut för att tas med i indexet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

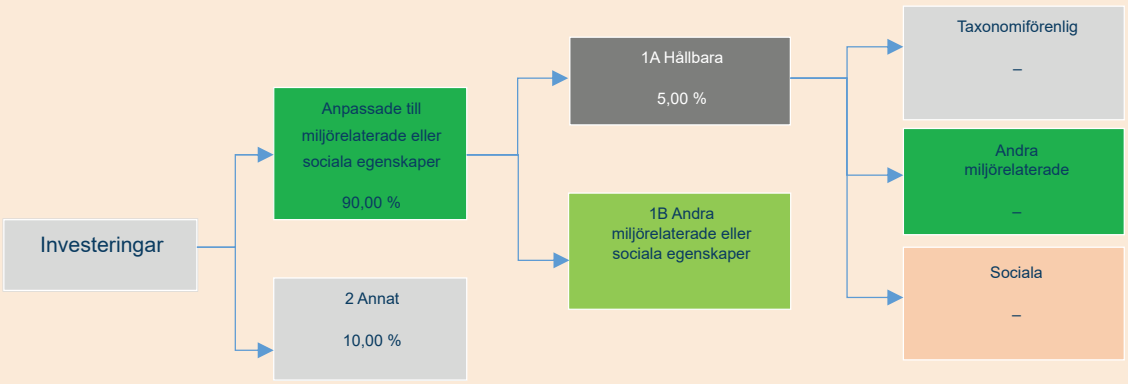
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[122]?

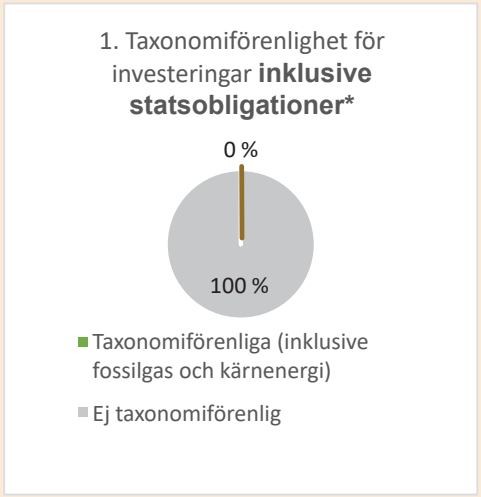
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[122] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.


är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

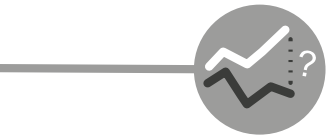
Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Det finns inga lägsta miljömässiga eller sociala garantier.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect ESG Filtered Index (”indexet”) strävar efter att representera resultatet för företag som är förknippade med utvecklingen av nya produkter och tjänster från tekniska innovationer som leder till genombrott inom områden som internet och digitalisering, mobilitet, autonom teknik, industriell automatisering och digital sjukvård samtidigt som det utesluter företag som är involverade i vissa kontroversiella affärsverksamheter eller har relativt låga MSCI ESG-kontroversbetyg eller MSCI ESG-betyg.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi MSCI China ESG Selection

Identifieringskod för juridiska personer:
213800YL23YUT5FBRB63

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [x] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [x] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod

följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet för MSCI China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) alla värdepapper i moderindexet. Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI China Index, genom att:
1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.
2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
– Företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.
– De företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.
3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i företag som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis

2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer. Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[123].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Delfonden följer resultatet för MSCI China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. MSCI China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI China Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i det kinesiska aktieområdet som omfattar kinesiska A-aktier, H-aktier, B-aktier, Red chip-, P chip-aktier och utländskt noterade aktier (t.ex. amerikanska depåbevis) och är emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

[123] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

- ***Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI China ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperna väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som identifierar bäst-i-klassen företag i MSCI China Index, genom att:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter enligt MSCI ESG Research: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol samt icke-konventionell olja och gas.
2. De återstående företagen bedöms utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
   – företag som inte redan ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.
   – de företag som för närvarande ingår i MSCI ESG Leaders-indexen måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”1” eller högre för att förbli godtagbara.
3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper från företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

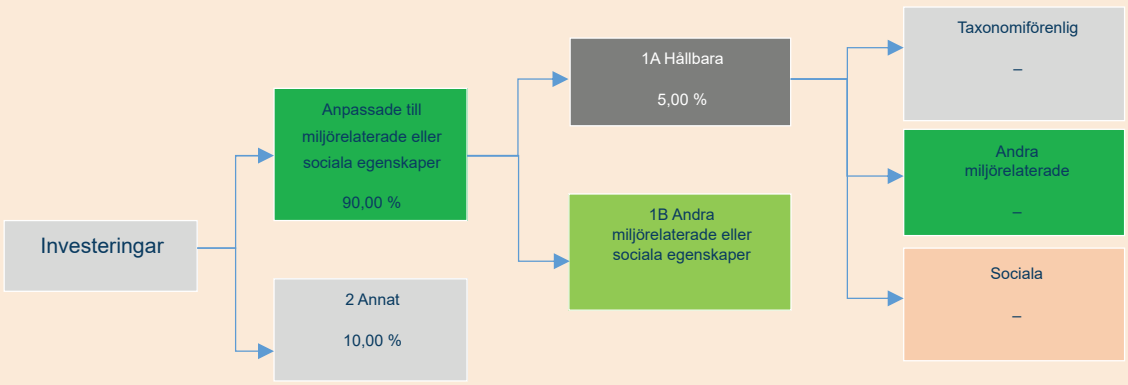
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[124]?

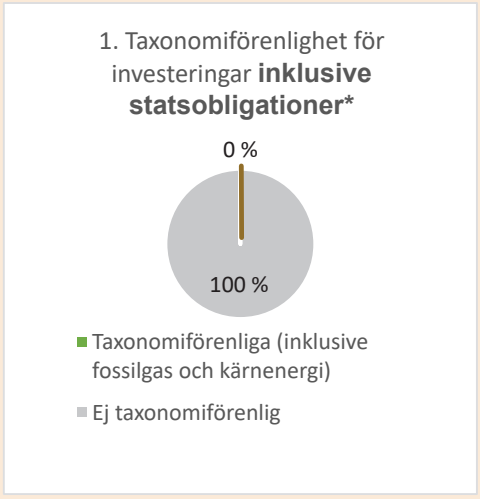
☐ Ja:

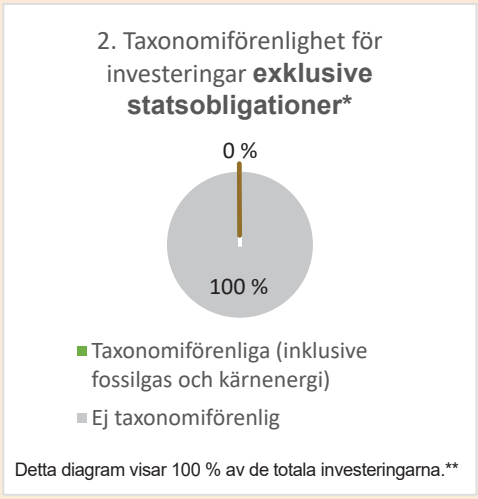
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[124] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.


är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI China ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI China Index (”moderindexet”), som är representativt för stora och medelstora företag i det kinesiska aktieområdet och som omfattar kinesiska A-aktier, H-aktier, B-aktier samt Red chip-, och P chip-aktier samt utländska värdepapper (t.ex. amerikanska depåbevis) emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology.



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

(till den 14 oktober 2026)

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI AC Far East Ex Japan ESG Selection

Identifieringskod för juridiska personer:
5493004IAZX5OHV2CQ46

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 10,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**



Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt består MSCI Ac Far East ex Japan ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) av värdepapper från följande tre index: MSCI China ESG Leaders Select index, MSCI EM ex China ESG Leaders Select index och MSCI World ESG Leaders Select index.
Värdepapperen i indexet MSCI China ESG Leaders Select, MSCI EM ex China ESG Leaders Select och MSCI World ESG Leaders Select väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som bygger på ”bäst-i-klassen” för företag i respektive moderindex, MSCI China, MSCI EM ex China och MSCI World, genom:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, icke-konventionell olja och gas och civila skjutvapen.

2. De återstående företagen bedöms därefter utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
   – Företag som inte är befintliga beståndsdelar i MSCI China ESG Leaders Select index, MSCI EM ex China ESG Leaders Select index eller MSCI World ESG Leaders Select index måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.
   – Befintliga beståndsdelar i indexen MSCI China ESG Leaders Select, MSCI EM ex China ESG Leaders Select och MSCI World ESG Leaders Select måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och MSCI ESG-kontroverser på 1 eller högre för att vara godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper i företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i respektive moderindex.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

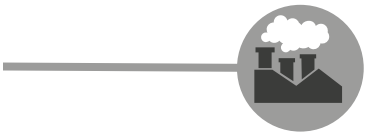
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



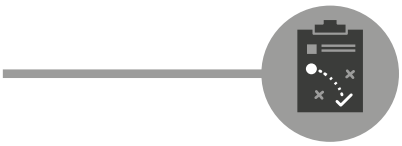
Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[125].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Ac Far East ex Japan ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI Ac Far East ex Japan ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI AC Far East ex Japan Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i två länder med utvecklade marknader (utom Japan) och sju tillväxtmarknadsländer i Fjärran Östern emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor i moderindexet.

[125] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. MSCI Ac Far East ex Japan ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped Index (”indexet”) består av värdepapper från följande tre index: MSCI China ESG Leaders Select index, MSCI EM ex China ESG Leaders Select index och MSCI World ESG Leaders Select index.

Värdepapperen i indexet MSCI China ESG Leaders Select, MSCI EM ex China ESG Leaders Select och MSCI World ESG Leaders Select väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess som bygger på ”bäst-i-klassen” för företag i respektive moderindex, MSCI China, MSCI EM ex China och MSCI World, genom:

1. Först och främst utesluta företag som är inblandade i följande affärsverksamheter: Alkohol, hasardspel, tobak, kärnkraft, konventionella vapen, kärnvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, icke-konventionell olja och gas och civila skjutvapen.

2. De återstående företagen bedöms därefter utifrån sin förmåga att hantera sina ESG-risker och -möjligheter och får ett betyg som avgör om de kan tas med i indexet:
– Företag som inte är befintliga beståndsdelar i MSCI China ESG Leaders Select index, MSCI EM ex China ESG Leaders Select index eller MSCI World ESG Leaders Select index måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och ett MSCI ESG-kontroversbetyg på ”3” eller högre för att vara godtagbara.
– Befintliga beståndsdelar i indexen MSCI China ESG Leaders Select, MSCI EM ex China ESG Leaders Select och MSCI World ESG Leaders Select måste ha ett MSCI ESG-betyg på ”BB” eller högre och MSCI ESG-kontroverser på 1 eller högre för att vara godtagbara.

3. En urvalsprocess tillämpas sedan på återstående godtagbara värdepapper som är bäst i klassen inom det valda området. Metoden syftar till att inkludera värdepapper i företag som har de högsta ESG-betygen och utgör 50 % av börsvärdet för varje sektor enligt Global Industry Classification Standard (GICS) som ingår i respektive moderindex.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 10 % hållbara investeringar enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 10 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
–Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
–Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[126]?***

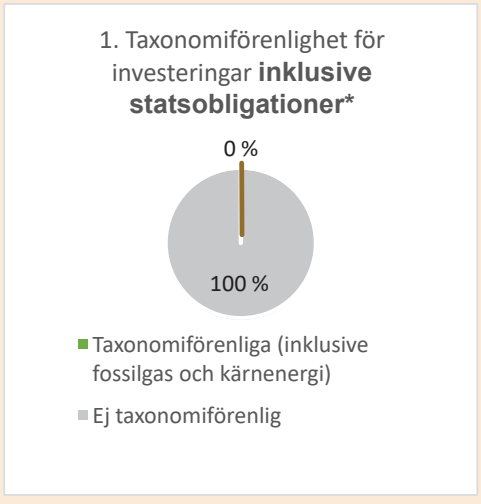
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är-verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[126] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.



är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 10 % hållbara investeringar med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



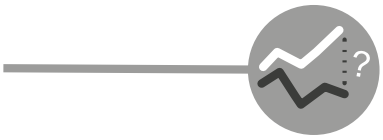
Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden har ingen minimiandel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 5% Issuer Capped index är ett aktieindex som är baserat på MSCI AC Far East ex Japan Index (”moderindexet”) och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 2 utvecklade länder (utom Japan) och 7 tillväxtmarknadsländer i Fjärran Östern som är emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

(från och med den 15 oktober 2026)

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Emerging Markets Screened

Identifieringskod för juridiska personer:
5493004IAZX5OHV2CQ46

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.



Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med följande ESG-metod:

i. Uteslutning av vissa verksamheter baserat på ESG-kriterier (fastställt enligt MSCI ESG Research-metodiken): tobak, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, utvinning av olja och gas i Arktis, energikolreserver och elproduktion från energikol. Dessutom utesluts företag som har identifierats vara inblandade i ESG-kontroverser eller inte följer FN:s Global Compact-principer (”UNGC”) från indexet, baserat på betyg och trösklar definierade av MSCI.

ii. En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet alla värdepapper i moderindexet. Indexets beståndsdelar väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet.
i. Först och främst utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamhet som inkluderar kontroversiella vapen, civila skjutvapen, tobak, elproduktion från energikol, energikolreserver och/eller utvinning av olja och gas i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser samt företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter.
ii. Dessutom tillämpar MSCI på det kvarvarande investeringsområdet en iterativ process med syfte att nå en minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet. Om minskningen av växthusgaser på 30 % jämfört med moderindexet inte nås tillämpas följande iterativa process:
1. Värdepapperen rangordnas i fallande ordning baserat på växthusgasintensitet.
2. Värdepapperet med högsta växthusgasintensitet utesluts och resulterande index jämförs med moderindexet för att avgöra om en 30 % minskning av växthusgasintensitet har uppnåtts.
3. Om minskningen har uppnåtts behövs inga ytterligare värdepapper.
Om minskningen inte har uppnåtts utesluts ytterligare värdepapper enligt steg 1 och 2 tills minskningen på 30 % har uppnåtts.

De återstående värdepapperen viktas sedan för det justerade fria omsättningsbara börsvärdet.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om MSCI ESG Research, om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster. Ytterligare information om ”röd flagg” finns nedan:
• Företag som bedöms vara inblandade i ESG-kontroverser som klassats som ”röd flagg” (MSCI ESG-kontroversbetyg 0). En röd flagga indikerar en pågående mycket allvarlig ESG-kontrovers som direkt innefattar ett företag genom dess handlingar, produkter eller verksamhet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

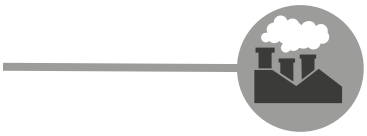
OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen

och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[127].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[127] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för MSCI EM Screened Select ex Thermal Coal Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI World Ex USA Index, som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i länder med utvecklade marknader (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på miljörelaterade, sociala och styrningsrelaterade kriterier. Indexet har dessutom som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Denna delfond är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Indexets beståndsdelar väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet.

– I första hand utesluts värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt affärsverksamhet som inkluderar kontroversiella vapen, civila skjutvapen, tobak, energikol och/eller okonventionell utvinning av olja och gas, inklusive i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter.

– I andra hand bedöms växthusgasintensiteten för återstående investeringsområde i förhållande till moderindexet. Om växthusgasintensiteten inte är minst 30 % lägre än i moderindexet utesluts ytterligare värdepapper från det återstående investeringsområdet för att nå 30 % minskning av växthusgasintenxiteten i förhållande till moderindexets växthusgasintensitet. Växthusgasintensitet på värdepappersnivå beräknas genom att dividera företagets växthusgasutsläpp med företagets värde, inklusive kontanter. Indexets växthusgasintensitet utgörs av det viktade genomsnittet av indexbeståndsdelarnas växthusgasintensitet. Sedan tillämpas följande iterativa process:
1. Värdepapperen rangordnas i fallande ordning baserat på växthusgasintensitet (med början i den lägsta).
2. Värdepapperet med högsta växthusgasintensitet utesluts och resulterande investeringsområde jämförs med moderindexet för att avgöra om 30 % minskning av växthusgasintensitet har uppnåtts.
3. Om minskningen har uppnåtts behövs inga ytterligare värdepapper.
Om minskningen inte har uppnåtts utesluts ytterligare värdepapper enligt steg 1 och 2 tills minskningen på 30 % har uppnåtts.
De återstående värdepapperen viktas sedan för det justerade fria omsättningsbara börsvärdet.

*Se indexmetoden på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.

**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster. Strategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

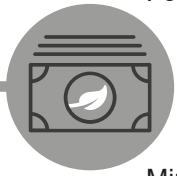
Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

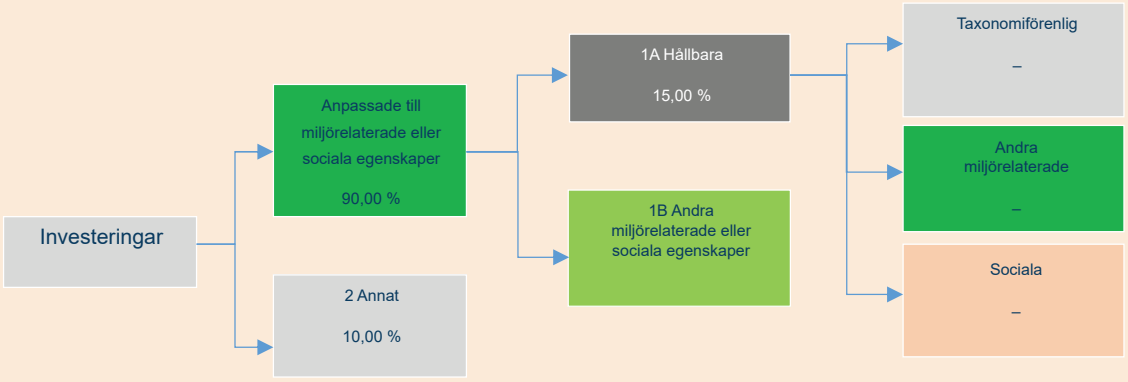
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15 % hållbara investeringar enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
–Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
–Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

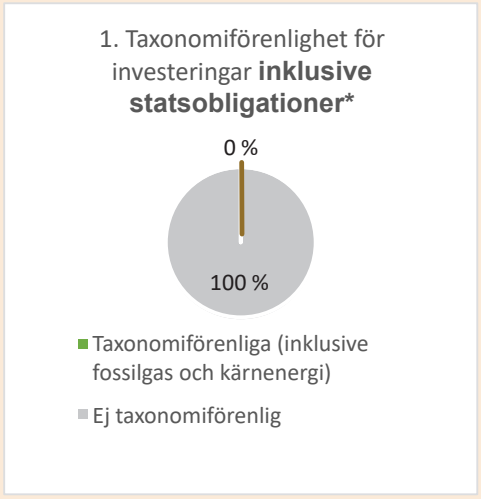
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[128]?***

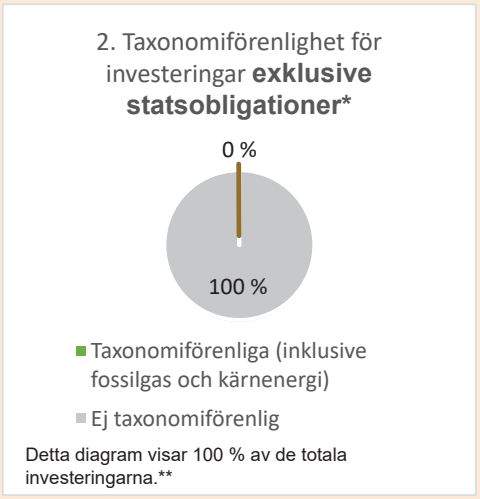
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[128] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden har ingen minimiandel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI EM Screened Select ex Thermal Coal Index, som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i länder med utvecklade marknader (”moderindexet”) och utesluter företag från moderindexet baserat på miljörelaterade, sociala och styrningsrelaterade kriterier. Indexet har dessutom som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.msci.com/index-methodology

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
AMUNDI MDAX ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800YZZ7KZKF3GHS38

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [x] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [x] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

ISS ESG-företagsbetyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

ISS ESG-företagsbetyget tillhandahåller relevanta och framåtblickande data och resultatbedömningar för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG). Med förankring i en helhetssyn på väsentlighet bedöms företagen mot en standarduppsättning universella ESG-teman och ytterligare branschspecifika teman. Väsentlighetsmetoden omfattar både väsentliga hållbarhetsrisker och negativa konsekvenser för samhället och miljön. Med utgångspunkt i en övergripande pool med mer än 700 indikatorer tillämpar ISS ESG cirka 100 sociala, miljö- och styrningsrelaterade indikatorer per betygsatt enhet, som täcker teman som personalfrågor, hantering av leverantörskedjan, affärsetik, bolagsstyrning, miljöstyrning, miljöeffektivitet och andra.

Differentierade viktningsscenarier säkerställer att de teman som är mest väsentliga för ett visst affärsområde/bransch beaktas vederbörligen. Förstklassig status (”Prime”) ges till betygsatta enheter som är ledande inom sina respektive branscher och som uppfyller krävande absoluta resultatförväntningar och därmed ses som väl positionerade för att hantera kritiska ESG-risker och dra nytta av möjligheter som erbjuds av omvandling mot hållbar utveckling.

ESG-företagsbetygsramen erkänner att risker och effekter för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning skiljer sig åt mellan olika branscher. Omfattningen av branschspecifika risker och effekter för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning definierar respektive resultatkrav, fördelningen av vikter mellan dessa betygsdimensioner och den förstklassiga tröskeln per sektor. Företag inom sektorer med hög risk och påverkan som olja och gas måste till exempel visa bättre resultat när det gäller sitt totala betyg än företag i lågrisksektorer som fastigheter för att få den förstklassiga ISS ESG-statusen. Närmare information om ISS ESG-företagsbetyg finns på följande länk:
https://www.issgovernance.com/file/publications/methodology/Corporate-Rating-Methodology.pdf

Närmare bestämt är målet för MDAX ESG+ index att återspegla resultatet för MDAX index och samtidigt använda ESG-uteslutningsfilter för att ta bort minst 20 % av beståndsdelarna i MDAX. Bolag som inte uppfyller normbaserade urval, urval för kontroversiella vapen, lägsta betyg för miljöfaktorer, sociala faktorer och bolagsstyrningsfaktorer och ett antal affärsverksamhetsurval enligt ISS-ESG enligt definitionen i indexmetoden utesluts. Om färre än 20 % av komponenterna i MDAX utesluts, utesluts de bolag som har lägst betyg för miljöfaktorer, sociala faktorer och bolagsstyrningsfaktorer enligt definitionen i indexmetoden. Uteslutna företag ersätts inte och därför kommer MDAX ESG+ index att ha färre antal innehav än moderindexet MDAX index (MDAX fokuserar på medelstora företag genom att följa resultatet för de 50 aktier som följer DAX-företag vad gäller fritt omsättningsbart börsvärde).

Indexet är konstruerat med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg i varje sektor (i enlighet med ISS-ESG) väljs ut för att sätta samman indexet. Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter). Gränserna för den icke-finansiella metoden anges i avsnittet Huvudsakliga risker i detta prospekt. Från DAX index tillämpas följande uppsättning uteslutningar:
1. ESG-betyg: företag med ESG-betyg från ISS-ESG på D- eller lägre utesluts från indexet.
2. Normbaserat urval: företag bedöms utifrån sin efterlevnad av internationella normer (mänskliga rättigheter, arbetsnormer, miljöskydd osv.) företag som identifierats som röda av ISS-ESG utesluts från indexet.

3. Kontroversiella vapen: företag bör inte ägna sig åt kontroversiella vapen som identifierats av ISS-ESG. Företag som är involverade i dessa verksamheter (truppminor, biologiska vapen, kärnvapen osv.) utesluts från indexet.
4. Affärsverksamheter: företag som ägnar sig åt tobak, brytning av termiskt kol, utvidgning av termisk brytning, oljesand, prospektering av arktisk olja och gas, uran till kärnkraft osv. kan uteslutas från indexet om deras intäkter överstiger en procentsats som fastställs i indexreglerna i indexet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer. Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.
Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[129].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

[129] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MDAX ESG+ (NR) EUR Index (”indexet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. MDAX ESG+ (NR) EUR Index är ett aktieindex baserat på MDAX Index (”moderindexet”) som är representativt för medelstora företag i Tyskland från traditionella sektorer, inklusive media, kemi, industri och finansiella tjänster och teknik som följer de företag som ingår i MDAX vad gäller börsvärde och orderingång. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg.

För att ingå i MDAX ESG+ beaktas endast företag som är noterade på en reglerad marknad. Dessutom måste företagen visa att deras rättsliga eller operativa bas är i Tyskland eller så måste de generera huvuddelen av sin handelsomsättning på Frankfurtbörsen och ha sitt huvudkontor i en EU- eller EFTA-medlemsstat.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Målet för MDAX ESG+ index är att återspegla resultatet för MDAX index och samtidigt använda ESG-uteslutningsfilter för att utesluta minst 20 % av beståndsdelarna i MDAX. Bolag som inte uppfyller normbaserade urval, urval för kontroversiella vapen, lägsta betyg för miljöfaktorer, sociala faktorer och bolagsstyrningsfaktorer och ett antal affärsverksamhetsurval enligt ISS-ESG enligt definitionen i indexmetoden utesluts. Om färre än 20 % av komponenterna i MDAX utesluts, utesluts de bolag som har lägst betyg för miljöfaktorer, sociala faktorer och bolagsstyrningsfaktorer enligt definitionen i indexmetoden.

Uteslutna företag ersätts inte och därför kommer MDAX ESG+ index att ha färre antal innehav än moderindexet MDAX index (MDAX fokuserar på medelstora företag genom att följa resultatet för de 50 aktier som följer DAX-företag vad gäller fritt omsättningsbart börsvärde).

Indexet är konstruerat med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg i varje sektor (i enlighet med ISS-ESG) väljs ut för att sätta samman indexet. Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter). Gränserna för den icke-finansiella metoden anges i avsnittet Huvudsakliga risker i detta prospekt. Från DAX index tillämpas följande uppsättning uteslutningar:
1. ESG-betyg: företag med ESG-betyg från ISS-ESG på D- eller lägre utesluts från indexet.
2. Normbaserat urval: företag bedöms utifrån sin efterlevnad av internationella normer (mänskliga rättigheter, arbetsnormer, miljöskydd osv.) företag som identifierats som röda av ISS-ESG utesluts från indexet.

3. Kontroversiella vapen: företag bör inte ägna sig åt kontroversiella vapen som identifierats av ISS-ESG. Företag som är involverade i dessa verksamheter (truppminor, biologiska vapen, kärnvapen osv.) utesluts från indexet.
4. Affärsverksamheter: företag som ägnar sig åt tobak, brytning av termiskt kol, utvidgning av termisk brytning, oljesand, prospektering av arktisk olja och gas, uran till kärnkraft osv. kan uteslutas från indexet om deras intäkter överstiger en procentsats som fastställs i indexreglerna i indexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

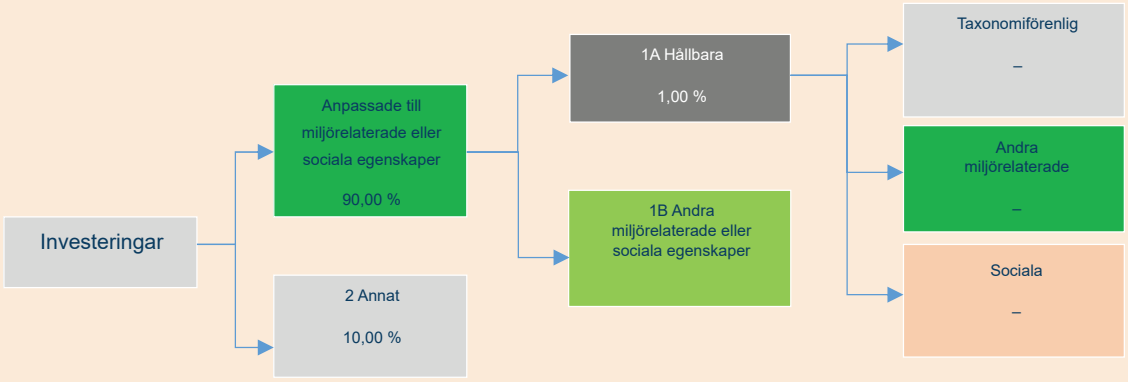
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram.
Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

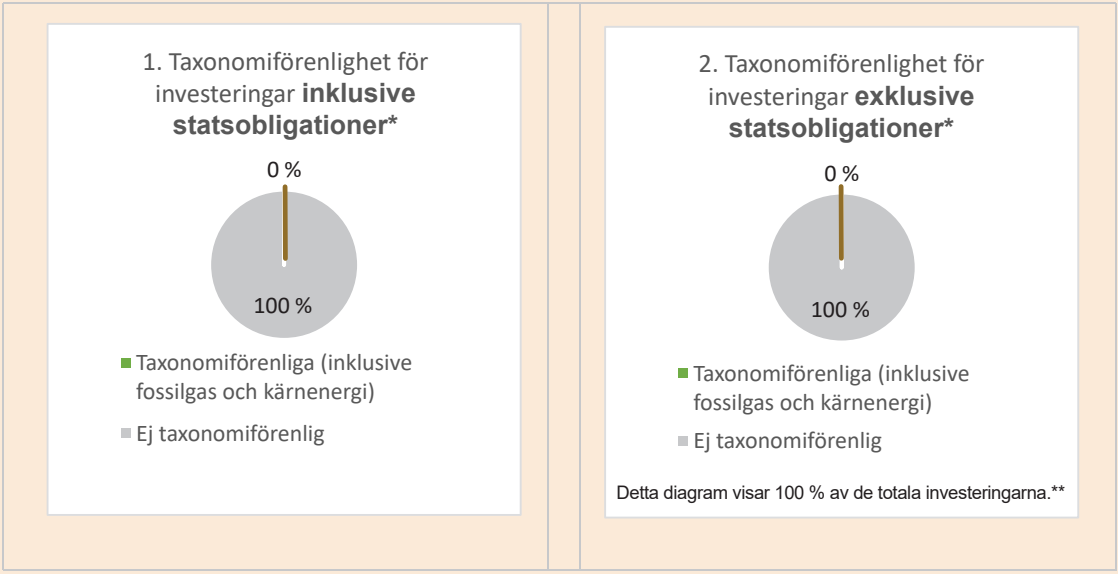
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[130]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[130] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

MDAX ESG+ (NR) EUR Index är ett aktieindex baserat på MDAX Index (”moderindexet”) som är representativt för medelstora företag i Tyskland från traditionella sektorer, inklusive media, kemi, industri och finansiella tjänster och teknik som följer de företag som ingår i MDAX vad gäller börsvärde och orderingång. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg.

För att ingå i MDAX ESG+ beaktas endast företag som är noterade på en reglerad marknad. Dessutom måste företagen visa att deras rättsliga eller operativa bas är i Tyskland eller så måste de generera huvuddelen av sin handelsomsättning på Frankfurtbörsen och ha sitt huvudkontor i en EU- eller EFTA-medlemsstat.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Ytterligare information om indexets underliggande komponenter finns på https://www.stoxx.com/rulebooks



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
AMUNDI LIFECYCLE 2039

Identifieringskod för juridiska personer:
213800Q6ZZQCXQ33GU04

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [x] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [x] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper bland annat genom att replikera FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Select Index (”indexet”), ett index som består av gröna statsobligationer med höga kreditbetyg från EMU-länder enligt det underliggande basindexet FTSE EMU Government Green Bond Select Index. För att vara godtagbar måste en obligation anses vara en ”grön obligation” enligt Climate Bonds Initiative.
Climate Bonds Initiative är en icke-vinstdrivande organisation som fokuserar på investerare genom att främja storskaliga investeringar som ger en global klimattålig ekonomi med låga koldioxidutsläpp (mer information finns på webbplatsen: http://www.climatebonds.net/). Climate Bonds Initiative har utvecklat och infört en uppsättning kriterier för att definiera gröna obligationer som får tas med i indexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den procentandel av fonden som Bloomberg har allokerat till obligationer som anses vara ”gröna obligationer” av Climate Bonds Initiative används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Närmare bestämt består FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Select Index av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.

Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt.

Dessutom består FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Select Index bland annat av godtagbara globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.
– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter.

Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits.

Mer information finns i indexmetoden på ftserussell.com.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målet med de hållbara investeringarna är att investera i gröna obligationer emitterade av EMU-stater som uppfyller kriterierna för att inte orsaka betydande skada och minimiskyddsåtgärder enligt indexmetoden.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada investerar fonden inte i värdepapper som är emitterade av statliga emittenter på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat baserade på Bloombergs metodik. Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att investera på varje ombalanseringsdatum minst 5 % i gröna obligationer emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen).
Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

[ ] Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2039 (”måldatumet för indexet”). Indexet består av godtagbara värdepapper som består av fem underliggande basindex:
– FTSE Developed ESG Screened Select Index, ett aktieindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör de tre regionerna Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,
– FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, ett obligationsindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index
– Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer för statsobligationer, statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,
– FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer som har fast ränta och höga kreditbetyg, är denominerade i euro, är från EMU-länder och klassificeras som ”gröna obligationer” av data från Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat,
– FTSE EMU Government Bond Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg denominerade i euro och emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen),
– FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och emitterade av EMU-länder. I sin konstruktion beaktar indexet faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Select Index består av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.

Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt.

Dessutom består FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Select Index bland annat av globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.
– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter.

Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits.

Mer information om FTSE ESG-betyg, FTSE-uteslutningslistor och verksamheter finns i indexmetoden som finns på ftserussell.com.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

För varje värdepapper i företag som ingår i indexet förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde. Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

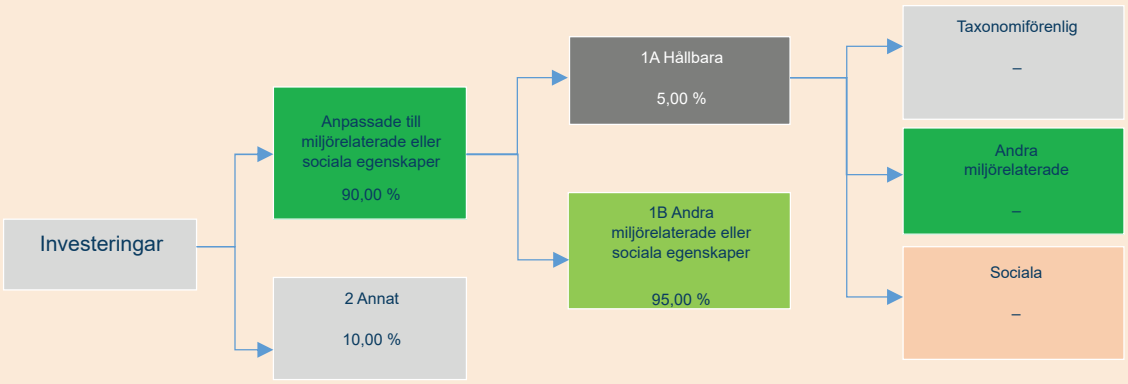
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

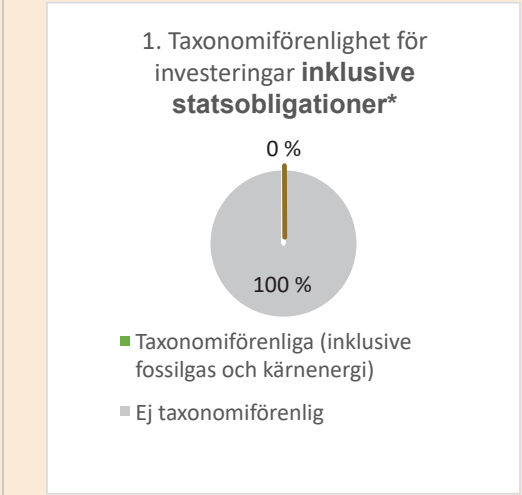
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[131]?***

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[131] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Delfonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin. Från och med 1 december 2039 är minimiåtagandet för hållbara investeringar noll.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet FTSE LIFECYCLE 2039 ESG SCREENED SELECT INDEX har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda referensvärdet från ett relevant brett marknadsindex?***

FTSE Lifecycle 2039 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar och värdepapper från det globala aktieindexet FTSE Developed ESG Screened Select Index, de räntebärande värdepapperen denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index, FTSE EMU Green Government Bond Select index, FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2039 (”måldatumet för indexet”).

I sin konstruktion beaktar indexet faktorer som miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) genom att utesluta företag eller minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan genom följande underliggande basindex FTSE Developed ESG Screened Select Index, FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index och FTSE EMU Green Government Bond Select index. De två återstående underliggande basindexen FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index utgörs av statsobligationer.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.lseg.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
AMUNDI LIFECYCLE 2036

Identifieringskod för juridiska personer:
213800V3R55V58C7HW47

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [x] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [x] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper bland annat genom att replikera FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Select Index (”indexet”), ett index som består av gröna statsobligationer med höga kreditbetyg från EMU-länder enligt det underliggande basindexet FTSE EMU Government Green Bond Select Index. För att vara godtagbar måste en obligation anses vara en ”grön obligation” enligt Climate Bonds Initiative.

Climate Bonds Initiative är en icke-vinstdrivande organisation som fokuserar på investerare genom att främja storskaliga investeringar som ger en global klimattålig ekonomi med låga koldioxidutsläpp (mer information finns på webbplatsen: http://www.climatebonds.net/). Climate Bonds Initiative har utvecklat och infört en uppsättning kriterier för att definiera gröna obligationer som får tas med i indexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den procentandel av fonden som Bloomberg har allokerat till obligationer som anses vara ”gröna obligationer” av Climate Bonds Initiative används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.
Närmare bestämt består FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Select Index av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.
Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt. Dessutom består FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Select Index bland annat av godtagbara globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.
– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter.

Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits.

Mer information finns i indexmetoden på ftserussell.com.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målet med de hållbara investeringarna är att investera i gröna obligationer emitterade av EMU-stater som uppfyller kriterierna för att inte orsaka betydande skada och minimiskyddsåtgärder enligt indexmetoden.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada investerar fonden inte i värdepapper som är emitterade av statliga emittenter på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat baserade på Bloombergs metodik. Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att investera på varje ombalanseringsdatum minst 5 % i gröna obligationer emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen).
Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

[ ] Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2036 (”måldatumet för indexet”). Indexet består av godtagbara värdepapper som består av fem underliggande basindex:

– FTSE Developed ESG Screened Select Index, ett aktieindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör de tre regionerna Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,

– FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, ett obligationsindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index

– Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer för statsobligationer, statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,
– FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer som har fast ränta och höga kreditbetyg, är denominerade i euro, är från EMU-länder och klassificeras som ”gröna obligationer” av data från Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat,
– FTSE EMU Government Bond Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg denominerade i euro och emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen),
– FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och emitterade av EMU-länder. I sin konstruktion beaktar indexet faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Select Index består av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.

Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt.

Dessutom består FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Select Index bland annat av globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.

– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter.

Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits.

Mer information om FTSE ESG-betyg, FTSE-uteslutningslistor och verksamheter finns i indexmetoden som finns på ftserussell.com.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

För varje värdepapper i företag som ingår i indexet förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde. Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

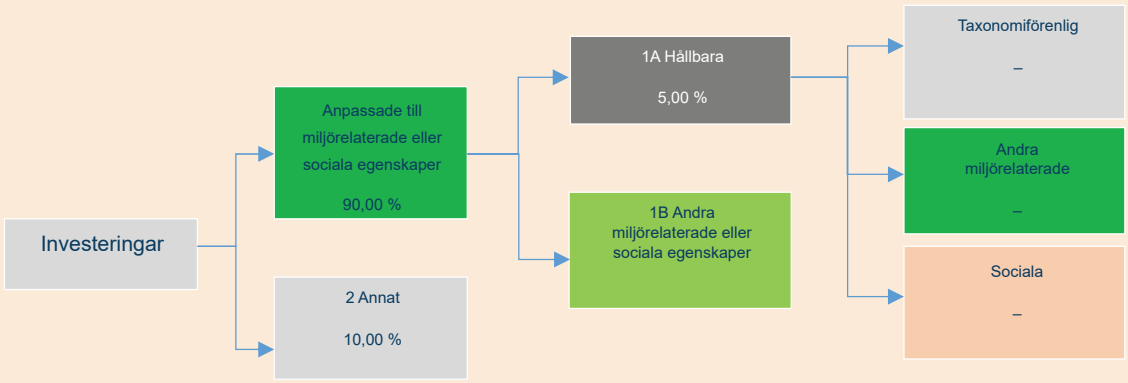
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[132]?

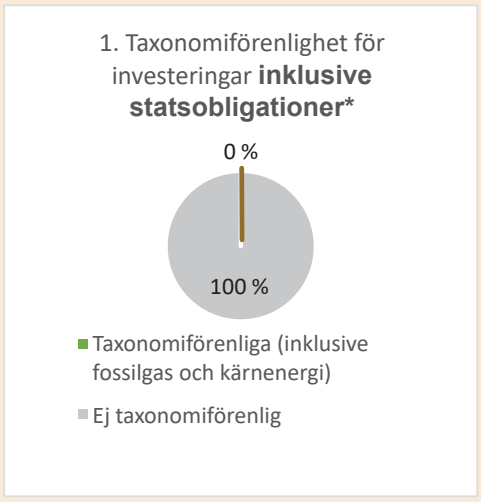
☐ Ja:

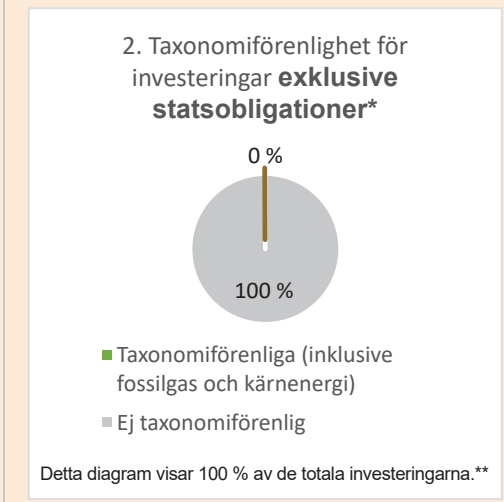
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Delfonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[132] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin. Från och med 1 december 2036 är minimiåtagandet för hållbara investeringar noll.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet FTSE LIFECYCLE 2036 ESG SCREENED SELECT INDEX har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

FTSE Lifecycle 2036 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar och värdepapper från det globala aktieindexet FTSE Developed ESG Screened Select Index, de räntebärande värdepapperen denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index, FTSE EMU Green Government Bond Select index, FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2036 (”måldatumet för indexet”).

I sin konstruktion beaktar indexet faktorer som miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) genom att utesluta företag eller minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan genom följande underliggande basindex FTSE Developed ESG Screened Select Index, FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index och FTSE EMU Green Government Bond Select index. De två återstående underliggande basindexen FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index utgörs av statsobligationer.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.lseg.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI LIFECYCLE 2033

Identifieringskod för juridiska personer:
213800NA8VARYI24O220

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:_____%**
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**



Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper bland annat genom att replikera FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Select Index (”indexet”), ett index som består av gröna statsobligationer med höga kreditbetyg från EMU-länder enligt det underliggande basindexet FTSE EMU Government Green Bond Select Index. För att vara godtagbar måste en obligation anses vara en ”grön obligation” enligt Climate Bonds Initiative.

Climate Bonds Initiative är en icke-vinstdrivande organisation som fokuserar på investerare genom att främja storskaliga investeringar som ger en global klimattålig ekonomi med låga koldioxidutsläpp (mer information finns på webbplatsen: http://www.climatebonds.net/). Climate Bonds Initiative har utvecklat och infört en uppsättning kriterier för att definiera gröna obligationer som får tas med i indexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den procentandel av fonden som Bloomberg har allokerat till obligationer som anses vara ”gröna obligationer” av Climate Bonds Initiative används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Närmare bestämt består FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Select Index av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.

Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt.

Dessutom består FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Select Index bland annat av godtagbara globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.
– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter.

Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits.

Mer information finns i indexmetoden på ftserussell.com.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målet med de hållbara investeringarna är att investera i gröna obligationer emitterade av EMU-stater som uppfyller kriterierna för att inte orsaka betydande skada och minimiskyddsåtgärder enligt indexmetoden.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada investerar fonden inte i värdepapper som är emitterade av statliga emittenter på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat baserade på Bloombergs metodik.

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att investera på varje ombalanseringsdatum minst 5 % i gröna obligationer emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen). Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

[ ] Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2033 (”måldatumet för indexet”). Indexet består av godtagbara värdepapper som består av fem underliggande basindex:

– FTSE Developed ESG Screened Select Index, ett aktieindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör de tre regionerna Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,

– FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, ett obligationsindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index – Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer för statsobligationer, statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,
– FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer som har fast ränta och höga kreditbetyg, är denominerade i euro, är från EMU-länder och klassificeras som ”gröna obligationer” av data från Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat,
– FTSE EMU Government Bond Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg denominerade i euro och emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen),
– FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och emitterade av EMU-länder. I sin konstruktion beaktar indexet faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Select Index består av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.

Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt.

Dessutom består FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Select Index bland annat av globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.
– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter. Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits.
Mer information om FTSE ESG-betyg, FTSE-uteslutningslistor och verksamheter finns i indexmetoden som finns på ftserussell.com.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

För varje värdepapper i företag som ingår i indexet förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

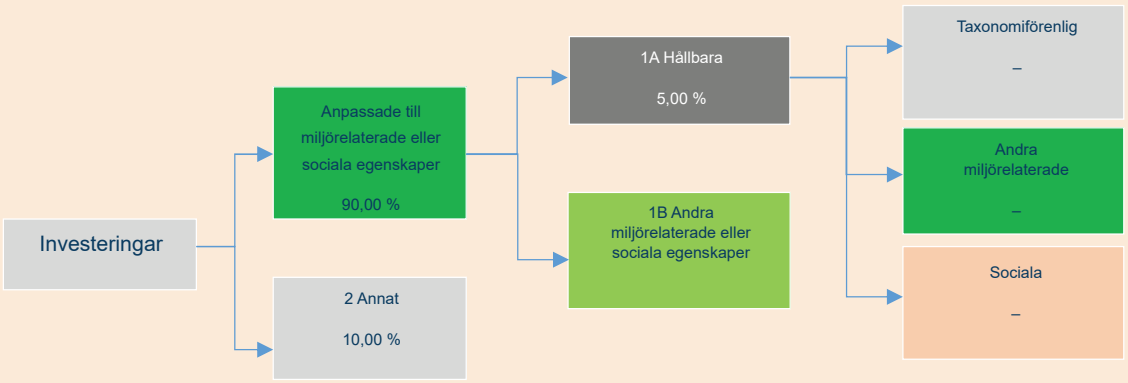
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[133]?

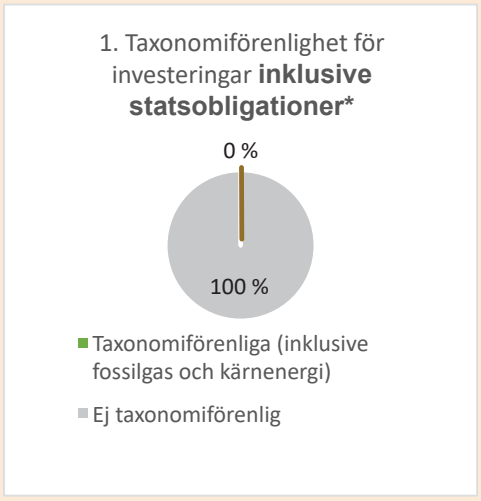
☐ Ja:

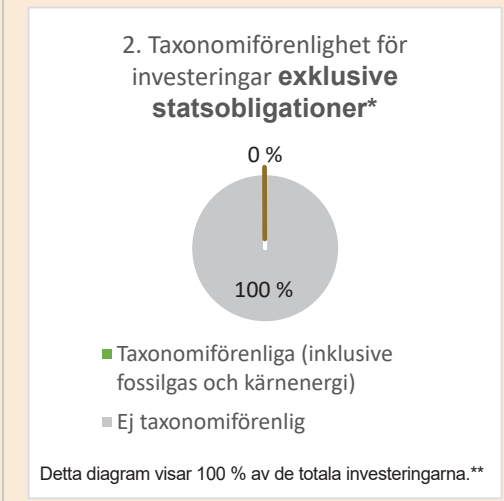
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Delfonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[133] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin. Från och med 1 december 2033 är minimiåtagandet för hållbara investeringar noll.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet FTSE LIFECYCLE 2033 ESG SCREENED SELECT INDEX har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

FTSE Lifecycle 2033 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar och värdepapper från det globala aktieindexet FTSE Developed ESG Screened Select Index, de räntebärande värdepapperen denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index, FTSE EMU Green Government Bond Select index, FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2033 (”måldatumet för indexet”).

I sin konstruktion beaktar indexet faktorer som miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) genom att utesluta företag eller minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan genom följande underliggande basindex FTSE Developed ESG Screened Select Index, FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index och FTSE EMU Green Government Bond Select index. De två återstående underliggande basindexen FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index utgörs av statsobligationer.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.lseg.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI LIFECYCLE 2030

Identifieringskod för juridiska personer:
213800MPBUPZZE5PRG82

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ☐ **Ja**
- ☒ **Nej**

- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: _____%**
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - ☐ med ett socialt mål
- ☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: _____%**
- ☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**



Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper bland annat genom att replikera FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Select Index (”indexet”), ett index som består av gröna statsobligationer med höga kreditbetyg från EMU-länder enligt det underliggande basindexet FTSE EMU Government Green Bond Select Index. För att vara godtagbar måste en obligation anses vara en ”grön obligation” enligt Climate Bonds Initiative.

Climate Bonds Initiative är en icke-vinstdrivande organisation som fokuserar på investerare genom att främja storskaliga investeringar som ger en global klimattålig ekonomi med låga koldioxidutsläpp (mer information finns på webbplatsen: http://www.climatebonds.net/). Climate Bonds Initiative har utvecklat och infört en uppsättning kriterier för att definiera gröna obligationer som får tas med i indexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den procentandel av fonden som Bloomberg har allokerat till obligationer som anses vara ”gröna obligationer” av Climate Bonds Initiative används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Närmare bestämt består FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Select Index av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.

Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt.

Dessutom består FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Select Index bland annat av godtagbara globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.
– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter. Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits. Mer information finns i indexmetoden på ftserussell.com.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målet med de hållbara investeringarna är att investera i gröna obligationer emitterade av EMU-stater som uppfyller kriterierna för att inte orsaka betydande skada och minimiskyddsåtgärder enligt indexmetoden.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada investerar fonden inte i värdepapper som är emitterade av statliga emittenter på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat baserade på Bloombergs metodik. Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att investera på varje ombalanseringsdatum minst 5 % i gröna obligationer emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen). Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2030 (”måldatumet för indexet”). Indexet består av godtagbara värdepapper som består av fem underliggande basindex:

– FTSE Developed ESG Screened Select Index, ett aktieindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Developed Index, som representerar resultatet för stora och medelstora företag på utvecklade marknader som tillhör de tre regionerna Amerika, EMEA (Europa, Mellanöstern och Afrika) och APAC (Asien och Stillahavsområdet), som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,

– FTSE Euro Broad Investment-Grade Screened Select Corporate Bond Index, ett obligationsindex baserat på det börsvärdesviktade FTSE Euro Broad Investment Grade Corporate Index – Developed Markets, ett jämförelseindex med flera sektorer för statsobligationer, statsstödda obligationer, säkerställda obligationer och företagsobligationer med höga kreditbetyg, denominerade i euro som tillämpar en kombination av värdebaserade uteslutningar och en urvalsprocess för bäst i klassen,

– FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett obligationsindex som mäter resultatet för statsobligationer som har fast ränta och höga kreditbetyg, är denominerade i euro, är från EMU-länder och klassificeras som ”gröna obligationer” av data från Climate Bond Initiative (CBI) och emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat,

– FTSE EMU Government Bond Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg denominerade i euro och emitterade av EMU-länder (Ekonomiska och monetära unionen),

– FTSE EMU Government Bond 0-1 Year Select Index mäter resultatet för statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, med en återstående löptid på mindre än 1 år och emitterade av EMU-länder. I sin konstruktion beaktar indexet faktorer för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) för att minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

- ***Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Select Index består av godtagbara värdepapper från FTSE EMU Government Green Bond Select Index, ett underliggande basindex bestående av statsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg, denominerade i euro, är från EMU-länder och som klassificeras som en ”grön obligation” av Climate Bond Initiative (CBI), som används för att identifiera godtagbara gröna obligationer vars användning av intäkterna är i linje med Parisavtalet.

Kategoriseringen av underliggande obligationer baseras på en granskning av användningen av intäkter eller den egna märkningen av varje obligation. Gröna obligationer är obligationer som har gröna eller likvärdiga märkningar såsom klimat eller miljö och vars intäkter används för att finansiera eller återfinansiera godtagbara gröna projekt.

Dessutom består FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Select Index bland annat av globala aktier från FTSE Developed ESG Screened Select Index och räntebärande värdepapper från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Bond Index, två (2) underliggande basindex som granskar komponenterna och tillämpar följande ESG-filter:
– Emittenter utan täckning vad gäller ESG eller produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell tas bort från alla underliggande basindex.
– Emittenter med identifierad produktinblandning/kontroversiellt agerande enligt FTSE Russell utesluts från alla underliggande basindex.

Sedan tillämpas filtreringen ”bäst i klassen” så att 20 % av emittenterna tas bort baserat på en kombination av produktinblandning/kontroversiellt agerande och ESG-filter. Ytterligare ett ESG-urval tillämpas på global nivå för varje underliggande basindex för att säkerställa att de 20 % av emittenterna med lägst ESG-betyg har uteslutits.

Mer information om FTSE ESG-betyg, FTSE-uteslutningslistor och verksamheter finns i indexmetoden som finns på ftserussell.com.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

För varje värdepapper i företag som ingår i indexet förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

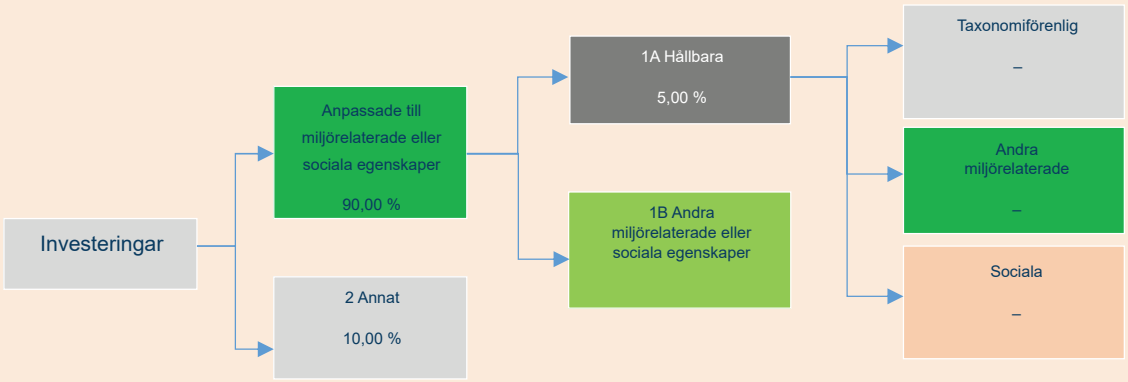
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[134]?***

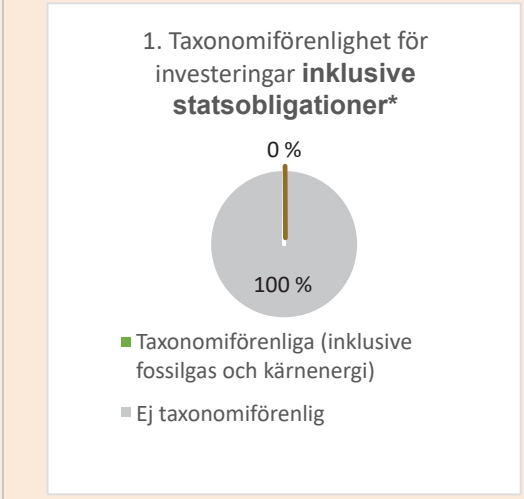
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

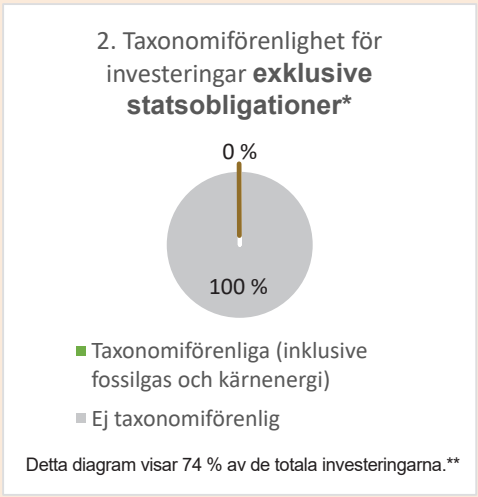
[134] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter ärverksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Delfonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

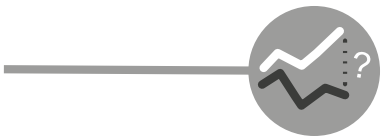
Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin. Från och med 1 december 2030 är minimiåtagandet för hållbara investeringar noll.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda referensvärdet från ett relevant brett marknadsindex?***

FTSE Lifecycle 2030 ESG Screened Select Index är ett index som är representativt för resultatet för ett diversifierat investeringsområde med flera tillgångar och värdepapper från det globala aktieindexet FTSE Developed ESG Screened Select Index, de räntebärande värdepapperen denominerade i euro från FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index, FTSE EMU Green Government Bond Select index, FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index, där vikten för varje godtagbar tillgångsklass justeras över tid baserat på en glidande skala, vilket minskar aktieexponeringen och ökar exponeringen mot räntebärande instrument till november 2030 (”måldatumet för indexet”).

I sin konstruktion beaktar indexet faktorer som miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning (ESG) genom att utesluta företag eller minska exponeringen mot vissa företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan genom följande underliggande basindex FTSE Developed ESG Screened Select Index, FTSE Euro Broad Investment-Grade ESG Screened Select Corporate Index och FTSE EMU Green Government Bond Select index. De två återstående underliggande basindexen FTSE EMU Government Bond Select Index och FTSE EMU Government Bond 0-1 Years Select Index utgörs av statsobligationer.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://www.lseg.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI ITALY MIB ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
549300RPOWOZJH77LP16

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [X] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [X] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”). Delfonden strävar efter att främja följande miljörelaterade och sociala egenskaper:

– 30 % minskning av koldioxidintensiteten jämfört med det godtagbara investeringsområdet
– förbättring av ESG-betyget jämfört med det godtagbara investeringsområdet

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Sustainalytics ESG-riskbetyg används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Sustainalytics ESG-riskbetyg (”ESG-betyget”) mäter ett företags exponering mot branschspecifika väsentliga ESG-risker och hur väl ett företag hanterar dessa risker. Exponering avser i vilken utsträckning ett företag är exponerad mot olika väsentliga ESG-frågor. Den beaktar delbransch och företagsspecifika faktorer såsom dess affärsmodell. Hantering avser hur väl ett företag hanterar sina relevanta ESG-frågor. Den bedömer hur robusta ett företags ESG-program, -rutiner och -policyer är.

Närmare information om Sustainalytics MSCI-riskbetyg finns på följande länk:
https://www.sustainalytics.com/esg-data?utm_medium=paid+search&utm_source=google&utm_campaign=sinv_esgrisk_global_2201_riskratings_en&utm_content=sinv_ga_global_2201_esgriskratings_en&utm_term=esg%20risk&utm_campaign=INV+-+ESG+risk+rating+-+May+2020&utm_source=adwords&utm_medium=ppc&hsa_acc=4619360780&hsa_cam=10048353808&hsa_grp=103763250889&hsa_ad=611330609406&hsa_src=g&hsa_tgt=kwd-348040994627&hsa_kw=esg%20risk&hsa_mt=b&hsa_net=adwords&hsa_ver=3&gclid=EAIaIQobChMIlv6qz6f5-wIVRbLVCh2X6wdGEAAYASAAEgLu9vD_BwE

Närmare bestämt sätts MIB ESG Index (”indexet”) samman av alla företag som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV och tillämpar följande filter:
De 40 främsta företagen vad gäller 6-månaders dagligt medianhandelsvärde (MDTV) är godtagbara.
– Företag med aktiva kritiska kontroverser relaterade till FN:s Global Compact som fastställts av Sustainalytics får inte tas med i indexet.
– Företag som enligt data från Sustainalytics är involverade i kontroversiella vapen, brytning av termiskt kol, koldriven kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte ingå i indexet.

Om poolen med godtagbara företag har färre än 35 beståndsdelar kommer ytterligare företag från det inledande investeringsområdet som uppfyller urvalskriterierna att läggas till i ordning efter högst fritt omsättningsbart börsvärde tills det totala antalet utvalda företag når 35. Varje värdepappers vikt i indexet bestäms av en optimeringsprocess för att uppfylla nedanstående begränsningar:
– minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det godtagbara investeringsområdet
– förbättrat ESG-betyg jämfört med det godtagbara investeringsområdet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första filtret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[135].

135 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

– **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MIB ESG Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på de 40 mest likvida italienska aktierna med högst börsvärde som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV (det ”godtagbara investeringsområdet”). Indexet utesluter företag från det godtagbara investeringsområdet baserat på kriterier för miljö, socialt ansvar eller bolagsstyrning och strävar efter en minsta minskning av koldioxidintensiteten på 30 % i förhållande till investeringsområdet och ett förbättrat ESG-betyg jämfört med det godtagbara investeringsområdet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MIB ESG Index (”indexet”) baseras på alla företag som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV och tillämpar följande filter:
De 40 främsta företagen vad gäller 6-månaders dagligt medianhandelsvärde (MDTV) är godtagbara.

- Företag med aktiva kritiska kontroverser relaterade till FN:s Global Compact som fastställts av Sustainalytics får inte tas med i indexet.
- Företag som enligt data från Sustainalytics är involverade i kontroversiella vapen, brytning av termiskt kol, koldriven kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte ingå i indexet.

Om poolen med godtagbara företag har färre än 35 beståndsdelar kommer ytterligare företag från det inledande investeringsområdet som uppfyller urvalskriterierna att läggas till i ordning efter högst fritt omsättningsbart börsvärde tills det totala antalet utvalda företag når 35.

Varje värdepappers vikt i indexet bestäms av en optimeringsprocess för att uppfylla nedanstående begränsningar:

- minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med det godtagbara investeringsområdet
- förbättrat ESG-betyg jämfört med det godtagbara investeringsområdet.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

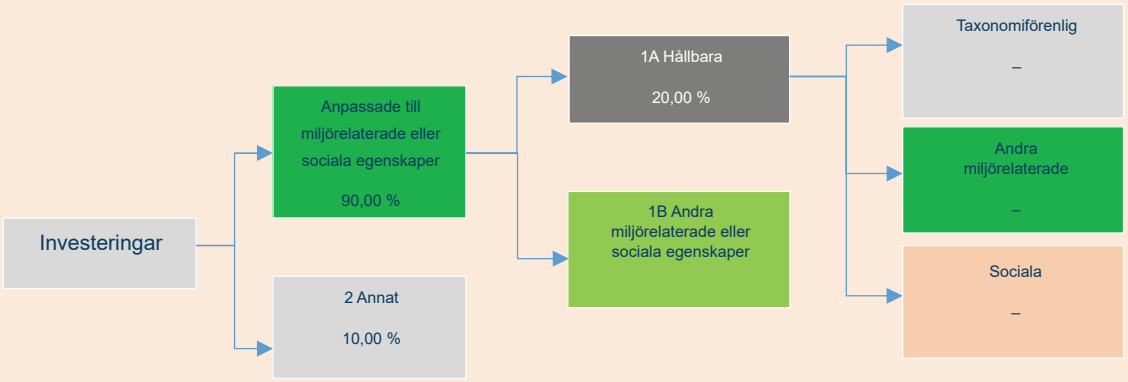
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

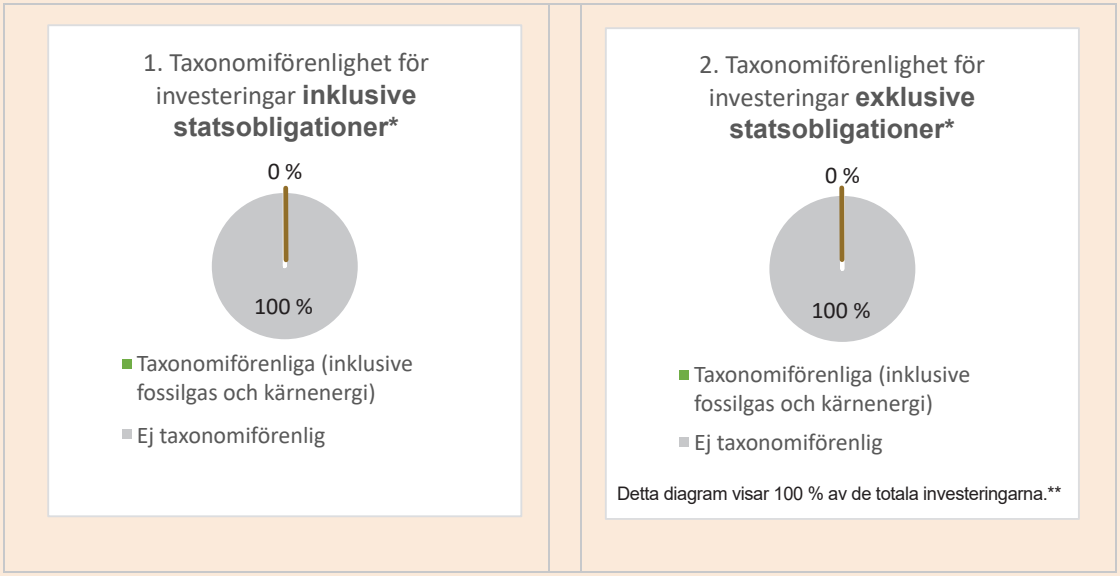
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[136]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[136] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Delfonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på de 40 mest likvida italienska aktierna med högst börsvärde som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV (det ”godtagbara investeringsområdet”). Indexet utesluter företag från det godtagbara investeringsområdet baserat på kriterier för miljö, socialt ansvar eller bolagsstyrning och strävar efter en minsta minskning av koldioxidintensiteten på 30 % i förhållande till investeringsområdet och ett förbättrat ESG-betyg jämfört med det godtagbara investeringsområdet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på https://live.euronext.com/en/products/indices

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi USD Corporate Bond ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
549300JEQE3CM0S0ZJ51

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG US Corporate Select Index (”indexet”) följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.

3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[137].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG US Corporate Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI ESG US Corporate Select Index är ett obligationsindex som är representativt för värdepapper från företag denominerade i USD med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index (”moderindexet”) och tillämpar sektorkriterier och ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

137 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI ESG US Corporate Select Index (”indexet”) tillämpar följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:

- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Mer information om affärsområden/verksamheter och urval finns i den indexmetod som finns på bloombergindices.com Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur,

revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

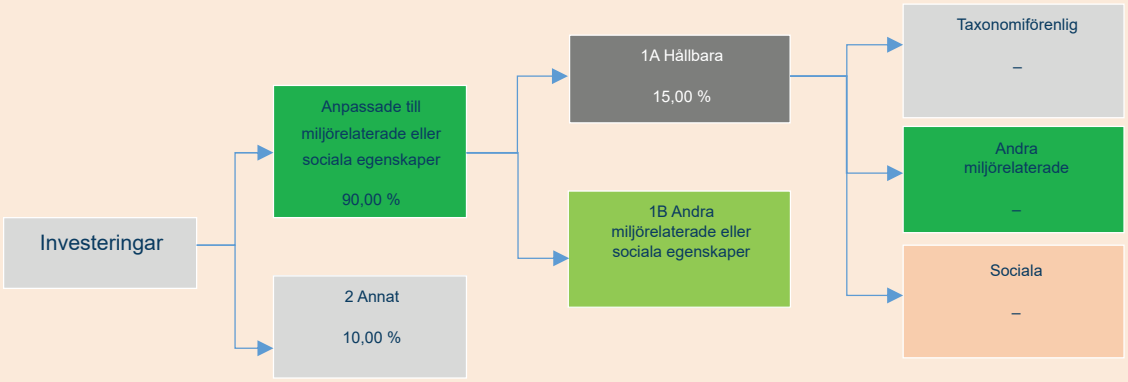
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[138]?

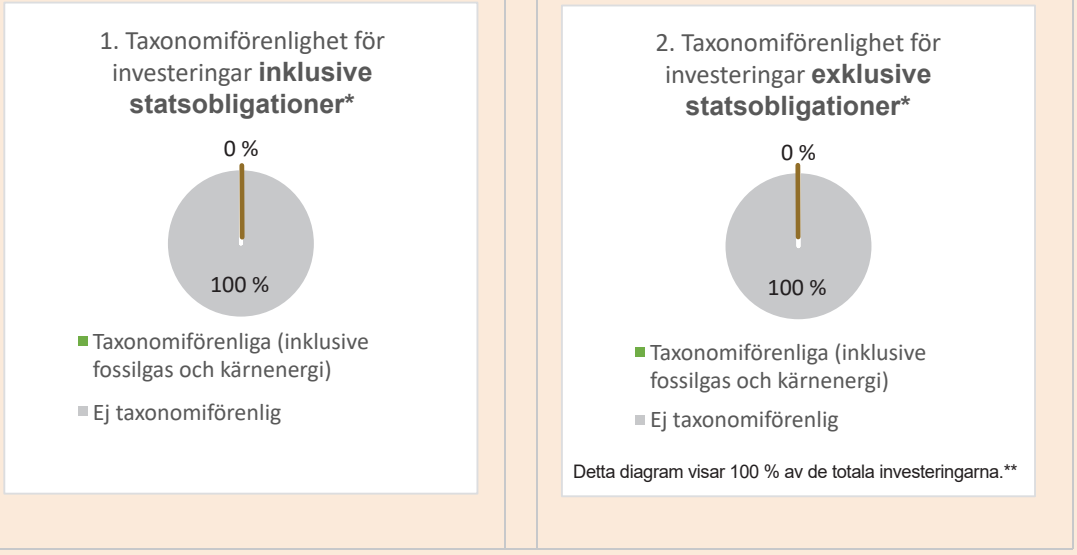
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[138] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som är representativt för värdepapper från företag denominerade i USD med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index (”moderindexet”) och tillämpar sektorkriterier och ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi EUR Corporate Bond ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
2221000A7N8FW0MB1V42

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 25,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate Select Index (”indexet”) följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.

3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett

andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

• ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

• ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

• bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[139].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

139 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate Select Index är ett obligationsindex som är representativt för värdepapper från företag denominerade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”moderindexet”) och tillämpar sektorkriterier och ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI ESG Euro Corporate Select Index (”indexet”) tillämpar följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.

3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde. De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

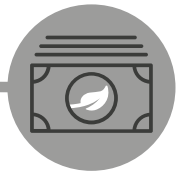
Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

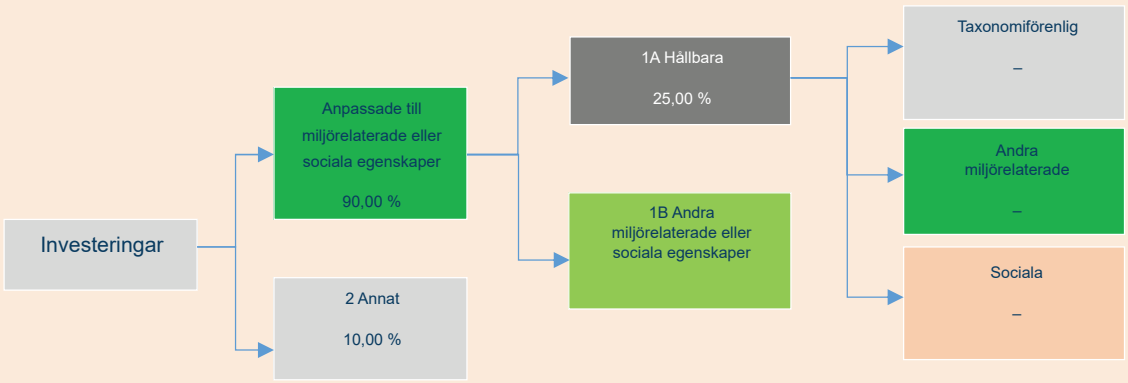
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 25,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram.
Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

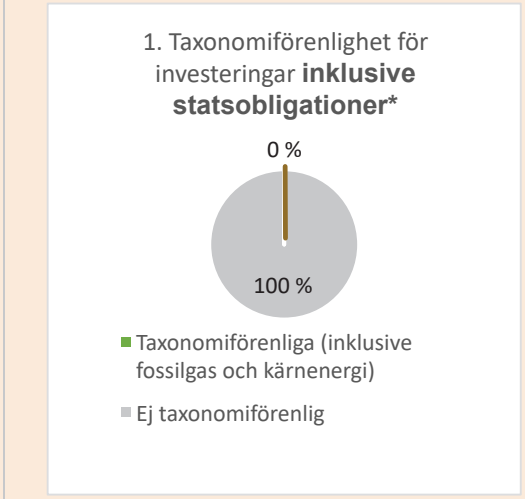
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[140]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[140] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 25 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 25 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som motsvarar företagsvärdepapper som är noterade i euro med fast ränta med höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (”moderindexet”) och använder sektorkriterier och ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi Euro Aggregate Bond ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800MNGINQA3GWTZ79

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor
som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG Euro Aggregate Sector Neutral Select Index (”indexet”) följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.

3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, justerade för att bibehålla en sektorneutral allokering till sitt moderindex. Sektorerna är statspapper, statsrelaterade, värdepapperiserade och företag på prospektdatumet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
– MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
– MSCI ESG-kontroverbetyg (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet)
Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.
*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:
1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[141].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

141 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Euro Aggregate Sector Neutral Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI ESG Euro Aggregate Sector Neutral Select Index är ett obligationsindex som är representativt för värdepapper denominerade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Index (”moderindexet”) och tillämpar sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index (”indexet”) tillämpar följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.

3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, justerade för att bibehålla en sektorneutral allokering till sitt moderindex. Sektorerna är statspapper, statsrelaterade, värdepapperiserade och företag på prospektdatumet.

Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

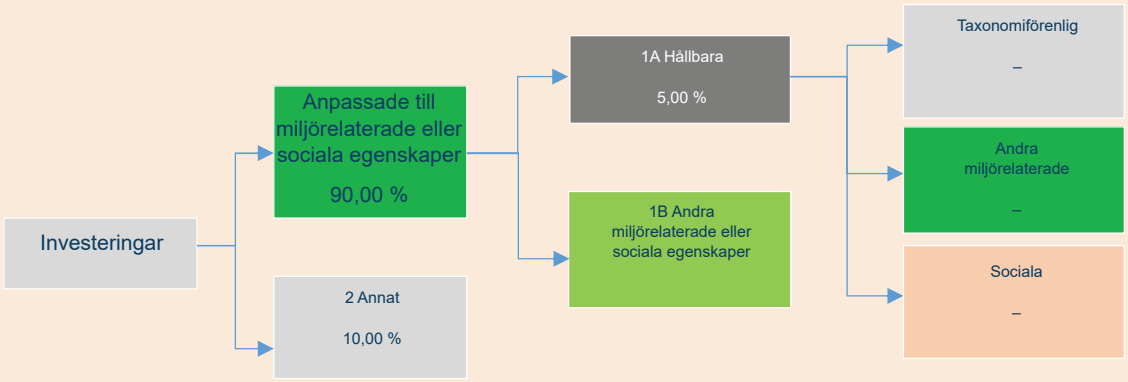
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[142]?

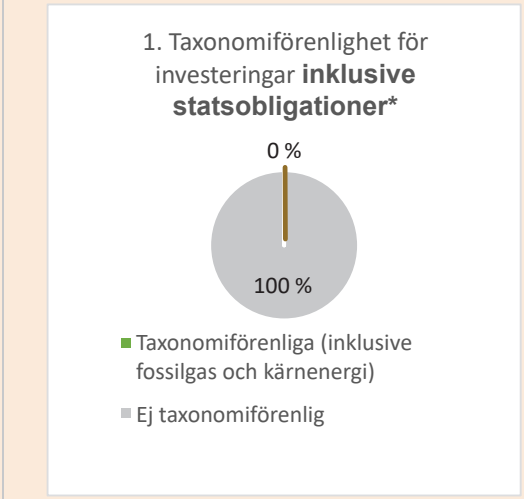
☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[142] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index är ett obligationsindex som motsvarar värdepapper som är noterade i euro med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Index (”moderindexet”) och använder sektor- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800NJSA5FHLC6HE45

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.
Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Det tillämpliga investeringsområdet består av obligationer med hög avkastning som är denominerade i USD, EUR och GBP som emitteras av företag på utvecklade marknader och ett lägsta utestående nominellt belopp med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Närmare bestämt erbjuder Bloomberg MSCI ESG Global Corporate High Yield Select Index (”indexet”) exponering mot marknaden med högavkastande företagsobligationer denominerade i USD, EUR och GBP. Indexet är ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Barclays. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i USD, EUR och GBP och emitteras av företag på utvecklade marknader väljer Blomberg Barclays obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till: (1) minsta utestående belopp på obligationsnivå, (2) återstående löptid, (3) emittenter som tillskrivits ett ESG-betyg (enligt MSCI:s definition). MSCI:s ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från ”AAA” till ”CCC”. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg, tillämpningen av godtagbarhetskriterier (1) till (3) leder till ett minskat investeringsområde (”det godtagbara området”), (v) Det godtagbara området granskas för att utesluta emittenter som: – är involverade i verksamheter som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, civila skjutvapen, militära vapen (enligt standarden Bloomberg MSCI SRI Screen), termiskt kol, generering av termiskt kol eller okonventionell olja och gas, – är involverade i större ESG-kontroverser (baserat på MSCI:s ESG-kontroversbetyg), – har ett ”ESG-betyg” som är lägre än BBB. Indexet använder en ”bäst i klassen”-metod, vilket är en metod där investeringar som är ledande eller har bäst resultat väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Genom att använda en sådan bäst i klassen-metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1. följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2. undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå. För att betraktas som en hållbar investering måste ett företag uppfylla ovanstående mål och inte ha någon betydande exponering mot verksamheter som anses oförenliga med långsiktiga mål för hållbar utveckling (t.ex. koldioxidintensiv energiproduktion och -distribution, tobak, vapen, spel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk).

Denna metod är specifik för investeringar i värdepapper. När Amundi investerar i fonder som förvaltas av tredje part förlitar Amundi sig på de policyer som tillämpas av den externa förvaltaren.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: – Det första filtret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn). Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak. Dessutom anses företag och ekonomiska aktörer som exponeras för allvarliga kontroverser i samband med arbetsvillkor, mänskliga rättigheter, biologisk mångfald och föroreningar inte vara hållbara investeringar. – Det andra filtret syftar till att verifiera att ett investeringsbolag inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Hos Amundi har indikatorerna för negativa konsekvenser beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Hos Amundi är OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[143].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Corporate High Yield Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Indexet ger exponering mot företagsobligationsmarknaden med hög avkastning denominerad i USD, EUR och GBP.

143 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Detta index är baserat på Bloomberg Global High Yield Corporate Index (”moderindexet”) och använder ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet består av obligationer med hög avkastning som är denominerade i USD, EUR och GBP som emitteras av företag på utvecklade marknader och ett lägsta utestående nominellt belopp med fasta minsta emissionsstorlekar som fastställts för alla godtagbara valutor, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

Närmare bestämt erbjuder Bloomberg Barclays MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index (”indexet”) exponering mot marknaden med högavkastande företagsobligationer denominerade i USD, EUR och GBP. Indexet är ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Barclays. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i USD, EUR och GBP och emitteras av företag på utvecklade marknader väljer Blomberg Barclays obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till: (1) minsta utestående belopp på obligationsnivå, (2) återstående löptid, (3) emittenter som tillskrivits ett ”ESG-betyg” (enligt MSCI:s definition). MSCI:s ESG-betyg ger företaget ett övergripande ESG-betyg på en sjugradig skala från ”AAA” till ”CCC”. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget.

ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. För att undvika tvivel utesluts företag utan ESG-betyg, tillämpningen av godtagbarhetskriterier (1) till (3) leder till ett minskat investeringsområde (”det godtagbara området”), (v) Det godtagbara området granskas för att utesluta emittenter som: – är involverade i verksamheter som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, civila skjutvapen, militära vapen (enligt standarden Bloomberg MSCI SRI Screen), termiskt kol, generering av termiskt kol eller okonventionell olja och gas, – är involverade i större ESG-kontroverser (baserat på MSCI:s ESG-kontroversbetyg), – har ett ”ESG-betyg” som är lägre än BBB. Indexet använder en ”bäst i klassen”-metod, vilket är en metod där investeringar som är ledande eller har bäst resultat väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Genom att använda en sådan bäst i klassen-metod följer delfonden en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

* Dessa uteslutningar tillämpas av fonden från den 1 maj 2025.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

För att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.
Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

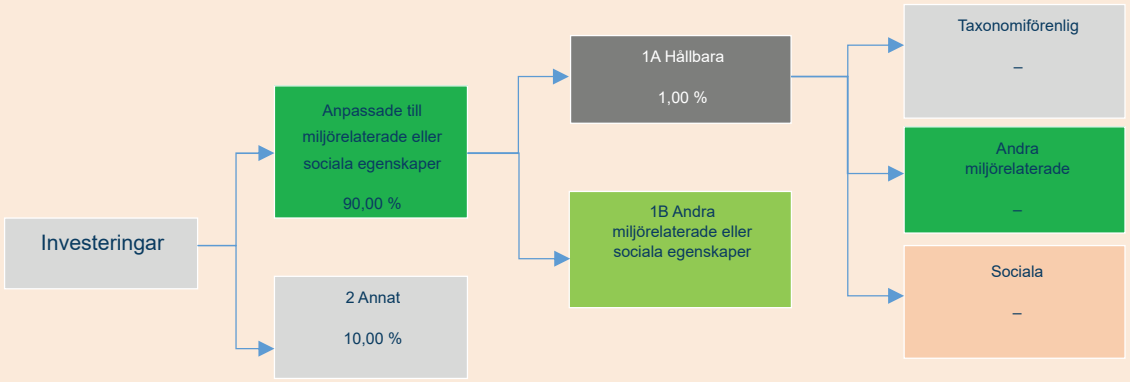
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram.
Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[144]?

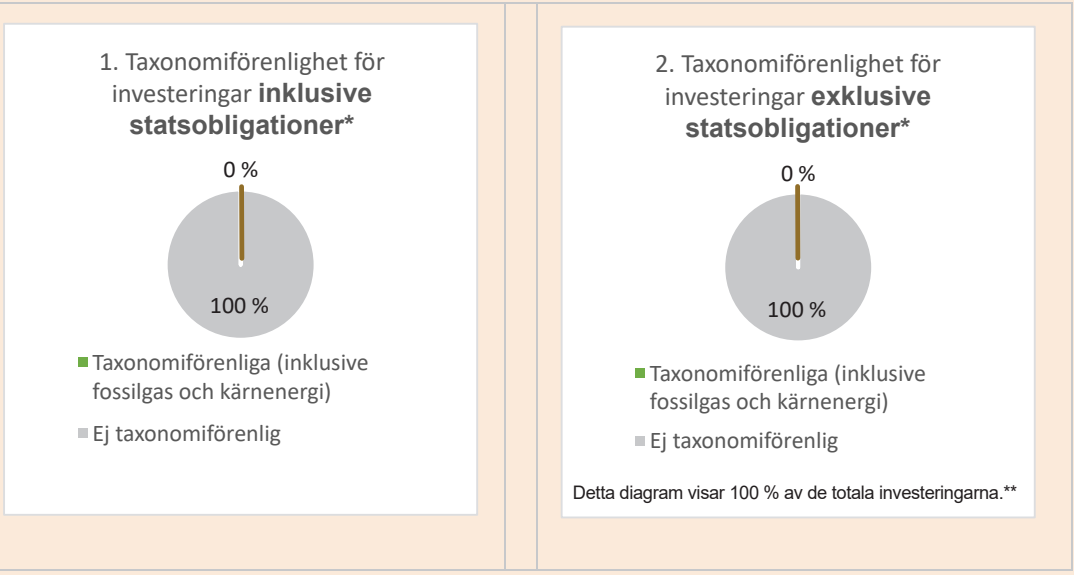
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[144] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Det finns inga lägsta miljömässiga eller sociala garantier.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet ger exponering mot företagsobligationsmarknaden med hög avkastning denominerad i USD, EUR och GBP.
Detta index är baserat på Bloomberg Global High Yield Corporate Index (”moderindexet”) och använder ytterligare kriterier för att inkludera emittenter med MSCI ESG-betyg på BBB eller högre och utesluter emittenter som är involverade i affärsverksamhet som omfattas av begränsningar enligt fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på: www.Bloomberg.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y Highest Rated ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800N2FV95PC2WZF51

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet. Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen.

Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik. Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf.

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG Global Corporate A+ 1-5 Year Select Index (”indexet”) följande filter:
1. De värdepapper som ingår i indexet måste ha betyget A- eller högre från minst två kreditvärderingsinstitut (Moody's, s&P eller Fitch) för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts. De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-urvalskriterierna ovan, kommer godtagbara emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. Om mer än en emittent har samma ESG-betyg och kontroversbetyg och måste tas bort för att nå tröskeln på 20 %, tas alla emittenter med samma ESG-betyg och kontroversbetyg bort.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1. följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2. undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå. För att betraktas som en hållbar investering måste ett företag uppfylla ovanstående mål och inte ha någon betydande exponering mot verksamheter som anses oförenliga med långsiktiga mål för hållbar utveckling (t.ex. koldioxidintensiv energiproduktion och -distribution, tobak, vapen, spel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk).

Denna metod är specifik för investeringar i värdepapper. När Amundi investerar i fonder som förvaltas av tredje part förlitar Amundi sig på de policyer som tillämpas av den externa förvaltaren.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

– Det första filtret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak.

Dessutom anses företag och ekonomiska aktörer som exponeras för allvarliga kontroverser i samband med arbetsvillkor, mänskliga rättigheter, biologisk mångfald och föroreningar inte vara hållbara investeringar.

– Det andra filtret syftar till att verifiera att ett investeringsbolag inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Hos Amundi har indikatorerna för negativa konsekvenser beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer) och
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Hos Amundi är OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[145].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Corporate A+ 1-5 Year Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett obligationsindex som består av företagsobligationer i flera valutor med höga kreditbetyg, fast ränta och en löptid mellan ett år och upp till, men inte inklusive fem år som använder sektor- och ESG-kriterier för säkerhetskvalificering.

145 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Indexet använder följande filter:
1. De värdepapper som ingår i indexet måste ha betyget A- eller högre från minst två kreditvärderingsinstitut (Moody's, s&P eller Fitch) för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts. De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-urvalskriterierna ovan, kommer godtagbara emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. Om mer än en emittent har samma ESG-betyg och kontroversbetyg och måste tas bort för att nå tröskeln på 20 %, tas alla emittenter med samma ESG-betyg och kontroversbetyg bort.

* Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

För att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

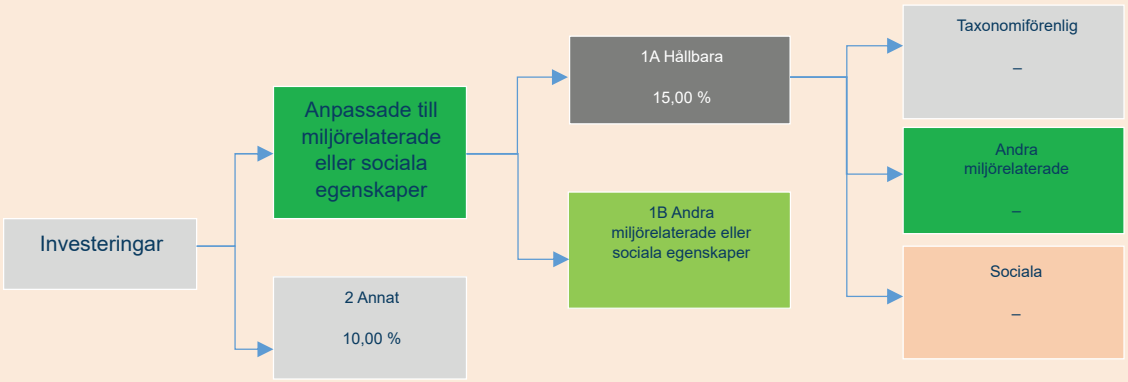
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

- ***Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?***

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[146]?***

☐ Ja:

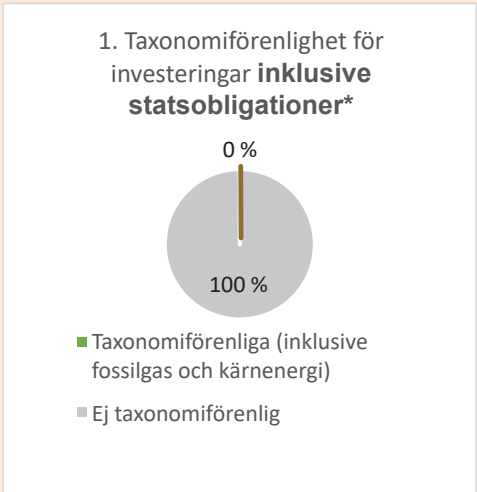
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[146] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

 är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga. Det finns inga lägsta miljömässiga eller sociala garantier.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett obligationsindex som består av företagsobligationer i flera valutor med höga kreditbetyg, fast ränta och en löptid mellan ett år och upp till, men inte inklusive fem år som använder sektor- och ESG-kriterier för säkerhetskvalificering.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på: https://www.bloomberg.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi Global Corporate Bond 1-5Y ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
222100AVKM1M7Q2EFT37

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 15,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG Global Corporate 1-5 Year Select Index (”indexet”) följande filter:
1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-urvalskriterierna ovan, kommer godtagbara emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. Om mer än en emittent har samma ESG-betyg och kontroversbetyg och måste tas bort för att nå tröskeln på 20 %, tas alla emittenter med samma ESG-betyg och kontroversbetyg bort.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:
Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:
Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s
Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[147].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

147 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Corporate 1-5 Year Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.
Bloomberg MSCI ESG Global Corporate 1-5 Year Select Index är ett obligationsindex som består av företagsobligationer i flera valutor med höga kreditbetyg, fast ränta och en återstående löptid på mellan 1 år och upp till men inte inklusive 5 år som tillämpar sektorkriterier och ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI ESG Global Corporate 1-5 Year Select Index (”indexet”) tillämpar följande filter:
1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-urvalskriterierna ovan, kommer godtagbara emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. Om mer än en emittent har samma ESG-betyg och kontroversbetyg och måste tas bort för att nå tröskeln på 20 %, tas alla emittenter med samma ESG-betyg och kontroversbetyg bort.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad

gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

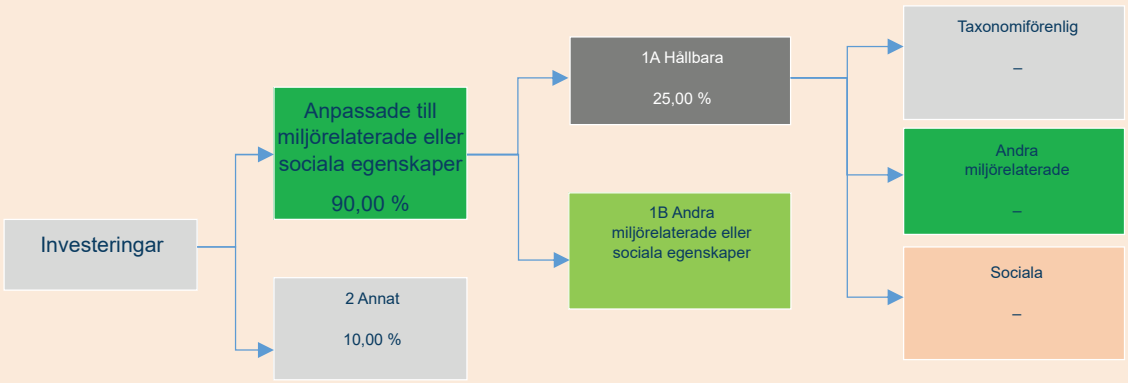
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gaseller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[148]?

☐ Ja:

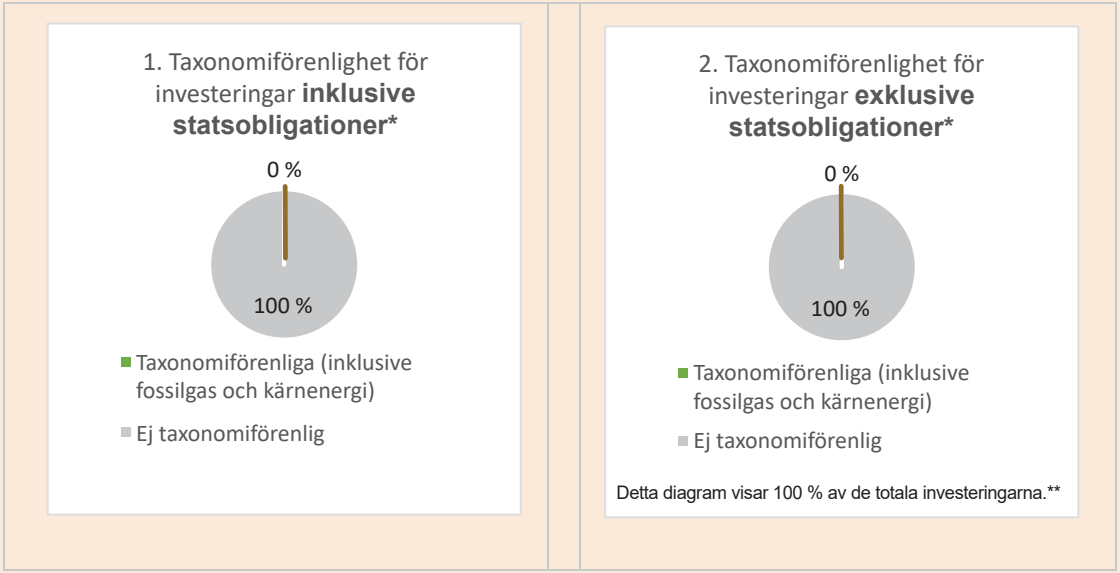
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

[148] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 15 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 15 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index är ett obligationsindex som består av företagsobligationer i flera valutor med höga kreditbetyg, fast ränta och en löptid mellan 1 år (inkluderat) och 5 år (exkluderat) som använder sektor- och ESG-kriterier för säkerhetskvalificering.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi Global Bioenergy

Identifieringskod för juridiska personer:
549300ZVYCLE5NKBFX60

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar en urvalsmetod för uteslutning vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Urvalsmetoden för uteslutning består av att utesluta minst 20 % av företagen från moderindexet (uttryckt i antal beståndsdelar) baserat på:

– kontroversiella affärsverksamheter

– ESG-kontroverser
– ett ESG-betyg om mindre än 20 % av moderindexet har uteslutits baserat på kontroversiella affärsverksamheter och ESG-kontroverser.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Sustainalytics ESG-riskbetyg används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. Sustainalytics ESG-riskbetyg (”ESG-betyget”) mäter ett företags exponering mot branschspecifika väsentliga ESG-risker och hur väl ett företag hanterar dessa risker. Exponering avser i vilken utsträckning ett företag är exponerad mot olika väsentliga ESG-frågor. Den beaktar delbransch och företagsspecifika faktorer såsom dess affärsmodell. Hantering avser hur väl ett företag hanterar sina relevanta ESG-frågor. Den bedömer hur robusta ett företags ESG-program, -rutiner och -policyer är.

Närmare information om Sustainalytics MSCI-riskbetyg finns på följande länk: https://www.sustainalytics.com/esg-data?utm_medium=paid+search&utm_source=google&utm_campaign=sinv_esgrisk_global_2201_riskratings_en&utm_content=sinv_ga_global_2201_esgriskratings_en&utm_term=esg%20risk&utm_campaign=INV+-+ESG+risk+rating+-+May+2020&utm_source=adwords&utm_medium=ppc&hsa_acc=4619360780&hsa_cam=10048353808&hsa_grp=103763250889&hsa_ad=611330609406&hsa_src=g&hsa_tgt=kwd348040994627&hsa_kw=esg%20risk&hsa_mt=b&hsa_net=adwords&hsa_ver=3&gclid=EAIaIQobChMIlv6qz6f5wIVRbLVCh2X6wdGEAAYASAAEgLu9vD_BwE

För att ett värdepapper ska väljas till Bloomberg BioEnergy Screened Index (”indexet”) måste det ingå i Bloomberg BioEnergy Benchmark Index (”moderindexet”). Moderindexets värdepapper uppfyller följande urvalskriterier:

– ingå i investeringsområdena utvecklade marknader, Kina eller Sydkorea
– klassificeras som tillhörande guld- eller silvernivåerna inom biobränsleekosystemet enligt Bloomberg Intelligence (BI) Theme-Basket-kommittén
– ha ett minsta fritt omsättningsbart börsvärde på 200 miljoner USD
– ha ett lägsta 90-dagars genomsnittligt dagligt handelsvärde på 2 miljoner USD.

Värdepapperen granskas beträffande eventuell inblandning i kontroversiella ESG-verksamheter. Data för kontroversiella ESG-kategorier kommer från ESG-dataleverantören Sustainalytics. Värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsverksamheter som: civila skjutvapen, kontroversiella vapen, militära kontrakt, tobak, okonventionell olja och gas, termiskt kol, el, kärnkraft eller i strid med FN:s Global Compact/OECD-riktlinjerna utesluts. Dessutom utesluts företag som har identifierats antingen i medelhög, hög eller allvarlig grad stå för en överträdelse beträffande följande kontroverser då de avser miljön:

samhällsrelationer, markanvändning och biologisk mångfald, utsläpp, avloppsvatten och avfall, energianvändning och utsläpp av växthusgaser, produkters miljöpåverkan, lobbying och offentlig politik, vattenanvändning och produkters koldioxidpåverkan.

Om mindre än 20 % av värdepapperen utesluts från Bloomberg BioEnergy Benchmark Index från ESG-uteslutningarna, kommer värdepapper med sämst ESG-betyg enligt data från Sustainalytics att uteslutas tills minst 20 % av värdepapperen är uteslutna från Bloomberg BioEnergy Benchmark Index.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).
Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:

Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

- ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
- ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
- bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[149].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg BioEnergy Screened Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Bloomberg BioEnergy Screened Index är konstruerat för att följa resultatet för företag som förväntas generera en betydande del av intäkterna från produktion, lagring och distribution av etanol, biodiesel och förnybart bränsle. Dessutom måste värdepapper uppfylla vissa ESG-minimistandarder.

149 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. För att ett värdepapper ska väljas till Bloomberg BioEnergy Screened Index (”indexet”) måste det ingå i Bloomberg BioEnergy Benchmark Index (”moderindexet”). Moderindexets värdepapper uppfyller följande urvalskriterier:

- ingå i investeringsområdena utvecklade marknader, Kina eller Sydkorea
- klassificeras som tillhörande guld- eller silvernivåerna inom biobränsleekosystemet enligt Bloomberg Intelligence (BI) Theme-Basket-kommittén
- ha ett minsta fritt omsättningsbart börsvärde på 200 miljoner USD
- ha ett lägsta 90-dagars genomsnittligt dagligt handelsvärde på 2 miljoner USD.

Värdepapperen granskas beträffande eventuell inblandning i kontroversiella ESG-verksamheter. Data för kontroversiella ESG-kategorier kommer från ESG-dataleverantören Sustainalytics. Värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsverksamheter som: civila skjutvapen, kontroversiella vapen, militära kontrakt, tobak, okonventionell olja och gas, termiskt kol, el, kärnkraft eller i strid med FN:s Global Compact/OECD-riktlinjerna utesluts. Dessutom utesluts företag som har identifierats antingen i medelhög, hög eller allvarlig grad stå för en överträdelse beträffande följande kontroverser då de avser miljön:

Samhällsrelationer, markanvändning och biologisk mångfald, utsläpp, avloppsvatten och avfall, energianvändning och utsläpp av växthusgaser, produkters miljöpåverkan, lobbying och offentlig politik, vattenanvändning och produkters koldioxidpåverkan. Om mindre än 20 % av värdepapperen utesluts från Bloomberg BioEnergy Benchmark Index från ESG-uteslutningarna, kommer värdepapper med sämst ESG-betyg enligt data från Sustainalytics att uteslutas tills minst 20 % av värdepapperen är uteslutna från Bloomberg BioEnergy Benchmark Index.
Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

För att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

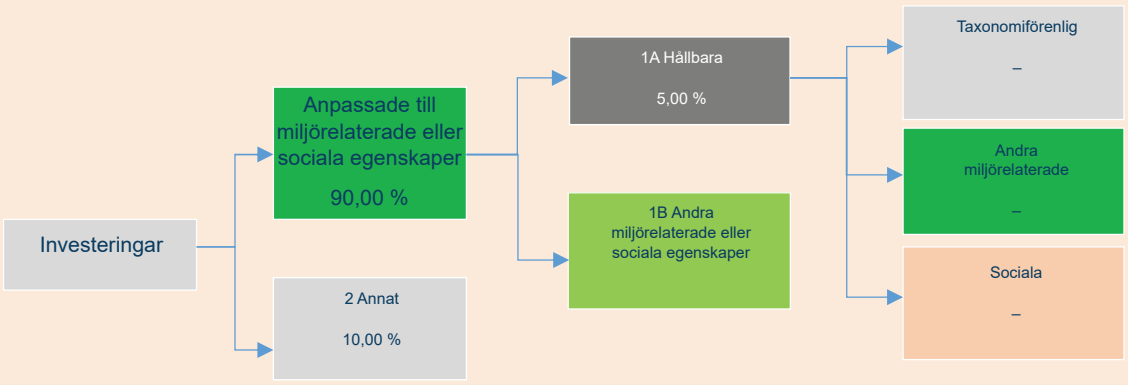
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[150]?

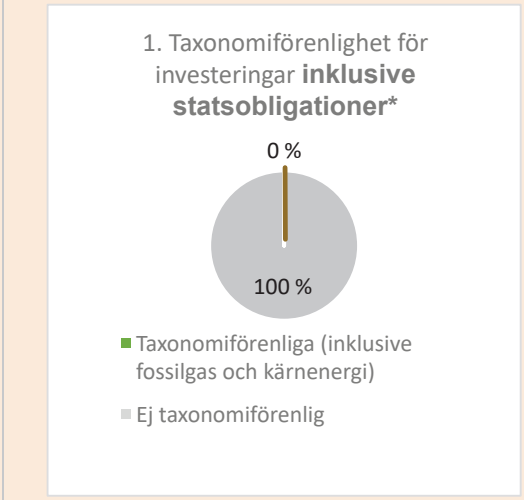
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[150] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.


är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?

Bloomberg BioEnergy ESG Index är konstruerat för att följa resultatet för företag som förväntas generera en betydande del av intäkterna från produktion, lagring och distribution av etanol, biodiesel och förnybart bränsle. Dessutom måste värdepapper uppfylla vissa ESG-minimistandarder.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

  Mer information om indexet finns på
  https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi Global Aggregate Bond 1-5Y ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800KMRNQ4SR4RKX08

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [X] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [X] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål
- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk: https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sector Neutral Select Index (”indexet”) följande filter:
1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet. De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå. Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[151].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sector Neutral Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sector Neutral Select Index är ett obligationsindex som är representativt för den globala marknaden för skuldförbindelser med fast ränta och höga kreditbetyg från både länder med utvecklade marknader och tillväxtmarknader med en återstående löptid på mellan 1 och 5 år som följer reglerna för Global Agg ex Securitized 500mn 1-5 Year (”moderindexet”) och tillämpar sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

151 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sector Neutral Select Index (”indexet”) tillämpar följande filter:
1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” MSCI ESG-kontroversbetyg, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (de med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

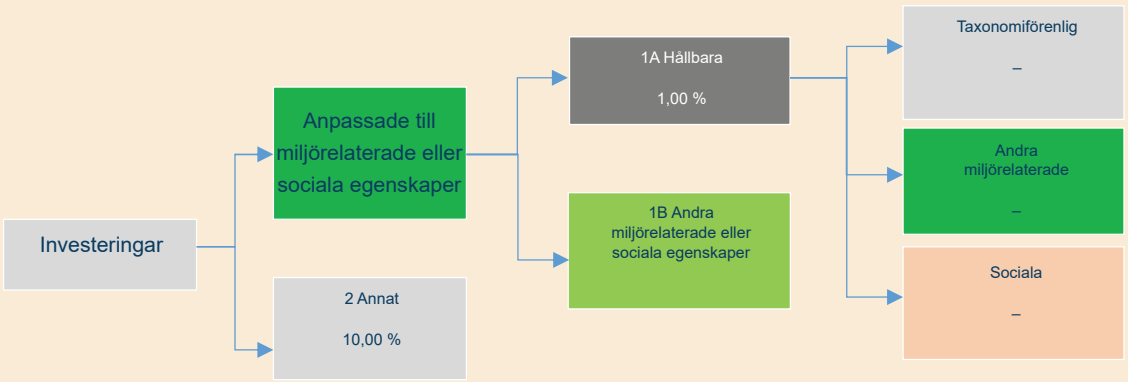
Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram.
Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[152]?

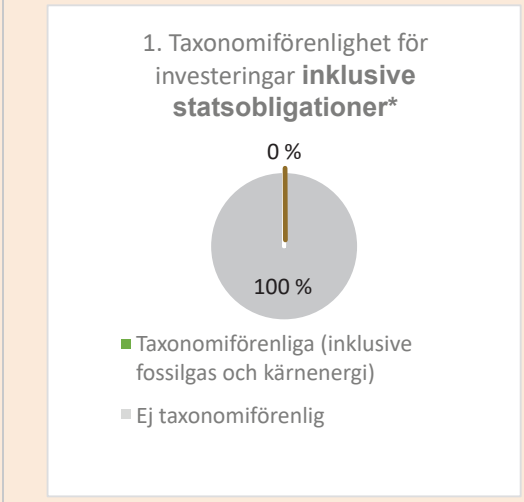
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål. **Omställningsverksamheter är-** verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

[152] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.



är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?

Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral Index är ett obligationsindex som är representativt för den globala marknaden för skuldförbindelser med fast ränta och höga kreditbetyg från både utvecklade marknader och tillväxtmarknader med en återstående löptid på mellan 1 och 5 år som följer reglerna för Global Agg ex Securitized 500mn 1-5 Year (”moderindexet”) och använder sektor- och ESG-kriterier för godtagbara värdepapper.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi Global Aggregate Bond ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
213800B37T1WLWBOYS44

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 1,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt tillämpar Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized Sector Neutral Select Index (”indexet”) följande filter:
1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.
2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.
De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
- MSCI ESG-kontroverser (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet).

Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.
Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[153].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized Sector Neutral Select Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized Sector Neutral Select Index är ett obligationsindex som är representativt för den globala marknaden för skuldförbindelser med fast ränta och höga kreditbetyg från både länder med utvecklade marknader och tillväxtmarknader som följer reglerna för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Index (”moderindexet”) och tillämpar sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI ESG Global Aggregate 500MM ex Securitized Sector Neutral Select Index (”indexet”) tillämpar följande filter:
1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara.

[153] https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

2. Företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval utesluts.
3. Företag med ett ”rött” betyg från MSCI ESG Impact Monitor, som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde, och i en ny skala för att bevara den sektorneutrala allokering som för det överordnade indexet. Om mindre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet har uteslutits efter att ha tillämpat ESG-filtren, kommer återstående emittenter att rangordnas enligt följande kriterier:
- MSCI ESG-betyg (De med högre ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet).
– MSCI ESG-kontroverbetyg (de med högre kontroversbetyg ges företräde till att bli kvar i indexet)
Baserat på denna rangordning utesluts emittenter från indexet tills antalet uteslutna emittenter är högre än 20 % av det totala antalet emittenter i det godtagbara investeringsområdet.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

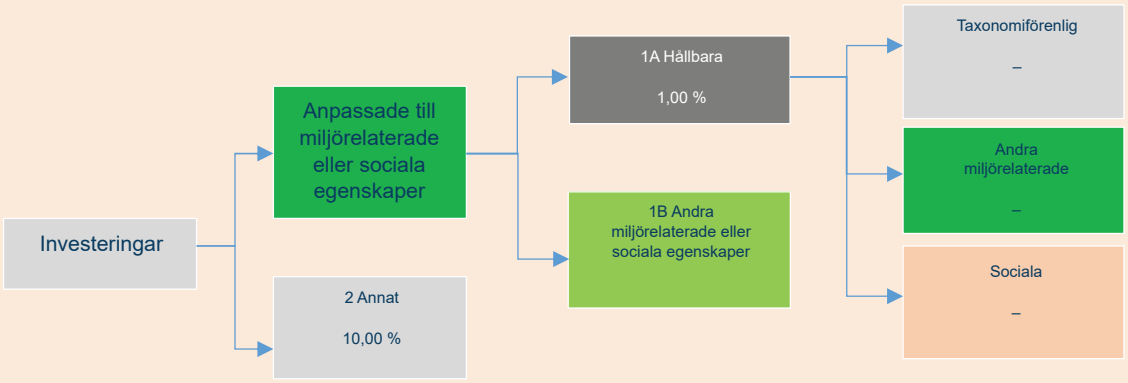
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 1,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[154]?

☐ Ja:

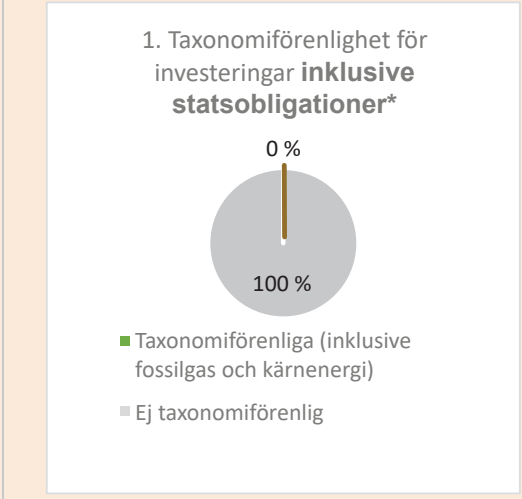
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

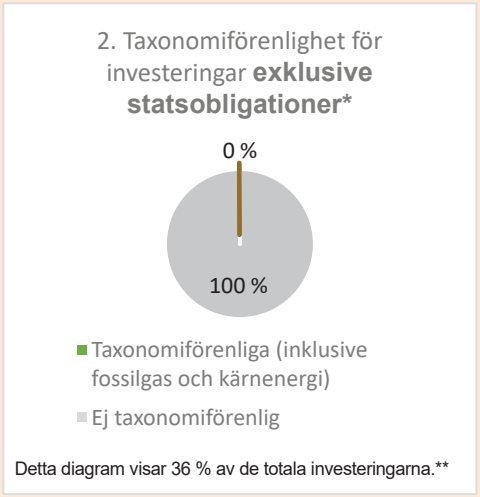
☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[154] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 1 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 1 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index är ett obligationsindex som representerar den globala marknaden för räntebärande instrument med fast ränta med höga kreditbetyg från emittenter på både utvecklade marknader och tillväxtmarknader som följer reglerna för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Index (”moderindexet”) och tillämpar sektorkriterier och ESG-kriterier för värdepappersurval.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:
549300WFFU01S3XDX018

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**	☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 20,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är konstruerad med hjälp av en metod för företag som är ”bäst i klassen”: företagen med bäst betyg väljs ut för att sätta samman indexet.

Metoden för företag som är ”bäst i klassen” är en metod där investeringar som är ledande eller presterar bäst väljs ut inom ett område, en branschsektor eller en klass. Med hjälp av en sådan metod följer indexet en icke-finansiell metod som gör det möjligt att minska det inledande investeringsområdet med minst 20 % (uttryckt i antal emittenter).

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt. MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt väljer iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index (”indexet”) bort beståndsdelar i moderindexet baserat på följande kriterier:

1. För det första utesluts värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval.
2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.
3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.

Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:

1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)
2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)
3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

• Ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)

• Ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn

• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

• Bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[155].
- **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med kreditbetyget BB/B emitterade av företagsemittenter som följer reglerna i iBoxx EUR High Yield TCA Index (”moderindexet”) och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

155 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt väljer iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index (”indexet”) bort beståndsdelar i moderindexet baserat på följande kriterier:
1. För det första utesluts värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval.
2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.
3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.

Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:
1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)
2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)
3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index (”indexet”) väljer ut komponenterna i det överordnade indexet utifrån följande kriterier:

1. För det första utesluts värdepapper i företag som ägnar sig åt affärsområden/verksamheter* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, konventionella och kontroversiella vapen, civila skjutvapen, termiskt kol eller fossila bränslen enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval.
2. Värdepapper från företag med MSCI ESG-betyg på BB och lägre utesluts.
3. Företag med ett MSCI ESG-kontroversbetyg som är lägre än 1 utesluts.

Om ovanstående MSCI ESG-screeningar resulterar i att mindre än 20 % av emittenterna utesluts från moderindexet vid varje ombalanseringsdag, tillämpas ytterligare rangordningsregler för emittenterna i det ESG-screenade området enligt följande:
1. MSCI ESG-betyg (fallande ordning)
2. MSCI ESG-kontroversbetyg (fallande ordning)
3. Emittentens marknadsvärde i det ESG-screenade området (fallande ordning)

Baserat på ovanstående rangordning kommer emittenter att uteslutas en i taget (med början från den lägst rankade emittenten) tills minimiregeln om uteslutning på 20 % är uppfylld.

De återstående värdepapperen viktas enligt sitt totala börsvärde med ett mjukt tak för emittenter på 3 %. Om det inte finns tillräckligt många olika emittenter för att uppfylla det mjuka taket kommer ett hårt tak på 5 % att användas.

*Se indexmetoden som finns på bloombergindices.com för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Indexet tillämpar uteslutningar på företag som är involverade i verksamheter som anses inte vara anpassade till referensvärdena för klimatomställning (kolutvinning, olja osv.). Dessa uteslutningar anges i artikel 12.1 a–c i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1818 av den 17 juli 2020 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2016/1011 vad gäller minimistandarder för EU-referensvärden för klimatomställning och EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Mer information finns i avsnittet ”Riktlinjer för fondnamn med ESG- eller hållbarhetsrelaterade termer” i prospektet.

* Dessa uteslutningar tillämpas av fonden från den 1 maj 2025.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi
Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

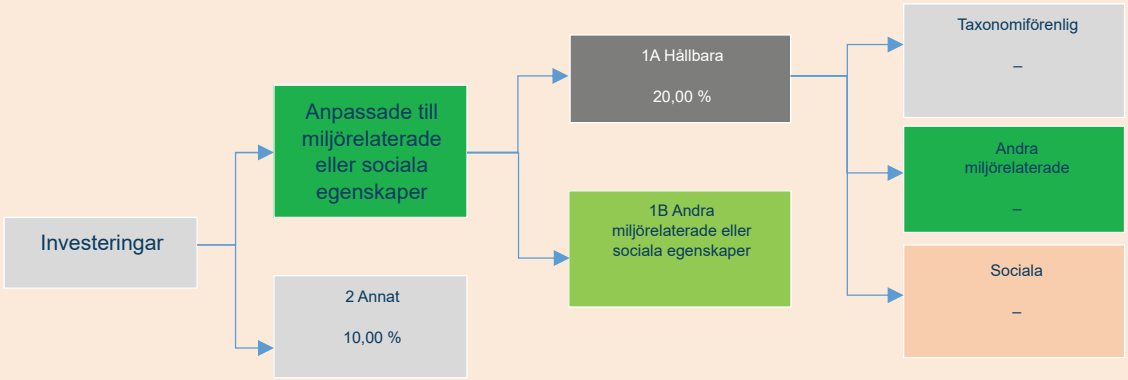
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[156]?

☐ Ja:

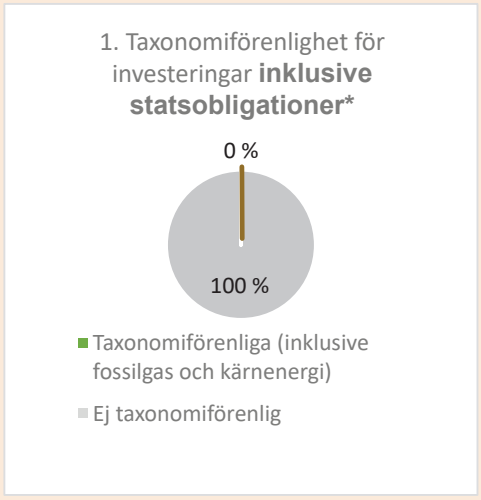
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

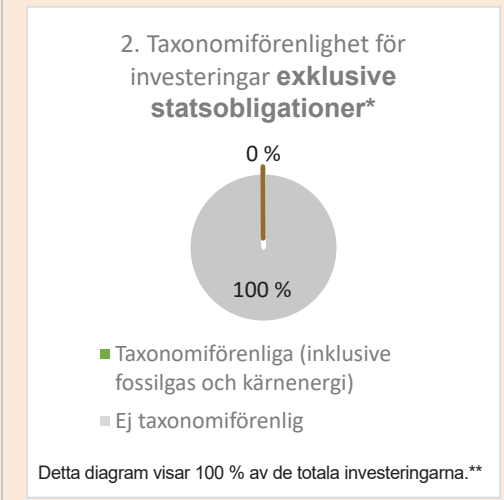
☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[156] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 20 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 20 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Den finansiella produkten investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för obligationer denominerade i euro med kreditbetyget BB/B emitterade av företagsemittenter som följer reglerna i iBoxx EUR High Yield TCA Index (”moderindexet”) och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?

Mer information om indexet finns på
https://www.markit.com/Documentation/Product/Iboxx



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND

Identifieringskod för juridiska personer:
54930086L1BR8DOJL973

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 25,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (”referensvärdet”), ett index för EMU-statsobligationer där de gröna obligationerna är överviktade med avseende på ett EMU-statsobligationsindex med standardmarknadsvärde.

Referensvärdet omfattar standardobligationer och gröna obligationer som är emitterade av EMU-stater. De obligationer som anses vara ”gröna obligationer” identifieras med hjälp av data från Bloomberg.

De gröna obligationerna i indexet är obligationer vars nettoobligationsintäkter kommer att vara helt avsedda för grön verksamhet som accepteras på marknaden baserat på Bloombergs klassificering (till exempel men inte endast förnybar energi, energieffektivitet, gröna byggnader och annat). Se www.bloomberg.com för mer information om godtagbara projektkategorier.

De gröna obligationerna granskas av Bloomberg för att säkerställa att de uppfyller minimikriterierna för att klassificeras lämpligt. Kriterierna återspeglar principerna för gröna obligationer som inkluderar:

– användning av intäkter
– projekturvalsprocess
– hantering av intäkter
– rapportering.

Alla gröna obligationer granskas årligen av Bloomberg för att bekräfta att intäkterna används för att stödja gröna projekt. Obligationer med intäkter som inte har bekräftats användas för gröna ändamål klassificeras inte längre som gröna av Bloomberg efter den senaste granskningsprocessen. Sådana värdepapper får ingå i moderindexet och förblir i indexet, men behandlas som icke-gröna obligationer, dvs. inkluderas inte i den totala vikten på 30 % gröna obligationer i indexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Den procentandel av fonden som Bloomberg har allokerat till obligationer som anses vara ”gröna obligationer” används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Närmare bestämt uppfyller metoden för Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (”referensvärdet”) följande kriterier:

–Godtagbara obligationer har ett utestående nominellt belopp på minst 1 miljard euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro vid indexets startdatum.

–Länder måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre) för att tas med i indexet enligt medelbetyget från Moody's, S&P och Fitch.

–Den återstående löptiden måste vara minst ett år, oavsett optionalitet.

–Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.

– Indexet ombalanseras varje månad. Före slutet av månaden bestäms indexsammansättningen för följande månad baserat på moderindexets värden för att fastställa den totala vikten av gröna obligationer till minst 30 % och upprätthålla en jämförbar riskprofil med moderindexet.

Dessutom utesluter indexet statliga emittenter som betecknas som ”inte fria” av Freedom House.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Målet med de hållbara investeringarna är att investera i gröna obligationer emitterade av EMU-stater som uppfyller kriterierna för att inte orsaka betydande skada och minimiskyddsåtgärder enligt indexmetoden.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada utesluter indexmetoden länder som betecknas som ”inte fria” av Freedom House. Dessutom kommer fonden inte att investera i värdepapper som är emitterade av statliga emittenter på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygs-kommitté

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat baserade på Bloombergs metodik.

Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté. Dessutom utesluter referensvärdet statliga emittenter som kategoriseras som ”inte fria” av Freedom House.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den huvudsakliga negativa konsekvensen 15 ”Växthusgasintensitet” beaktas genom att de gröna obligationerna överviktas med avseende på ett statsobligationsindex med standardmarknadsvärde. Gröna obligationer emitteras för att finansiera projekt som har positiva miljöresultat. Den huvudsakliga negativa konsekvensen 16 ”Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar” beaktas genom uteslutning från delfonden av länder på EU:s sanktionslista med en sanktion som består av frysning av tillgångar och ett sanktionsindex på högsta nivå (med beaktande av både USA:s och EU:s sanktioner), efter formell granskning och validering av Amundis betygskommitté. Dessutom utesluter referensvärdet statliga emittenter som kategoriseras som ”inte fria” av Freedom House.

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (”referensvärdet”) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index är baserat på Euro Treasury 50bn Bond Index (”moderindexet”) och mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta denominerade i euro. Indexet har en inriktning så att minst 30 % av indexets marknadsvärde på en ombalanseringsdag är allokerat till värdepapper som klassificeras som gröna obligationer och resterande procentandel är allokerad till icke-gröna obligationer, och riskprofilerna för indexet och moderindexet är jämförbara.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera referensvärdet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
Närmare bestämt uppfyller Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (”referensvärdet”) följande kriterier:

– Godtagbara obligationer har ett utestående nominellt belopp på minst 1 miljard euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro vid indexets startdatum.

– Länder måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre) för att tas med i indexet enligt medelbetyget från Moody's, S&P och Fitch.

– Den återstående löptiden måste vara minst ett år, oavsett optionalitet.

– Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.

– Indexet ombalanseras varje månad. Före slutet av månaden bestäms indexsammansättningen för följande månad baserat på moderindexets värden för att fastställa den totala vikten av gröna obligationer till minst 30 % och upprätthålla en jämförbar riskprofil med moderindexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Inte tillämpligt på statliga emittenter.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

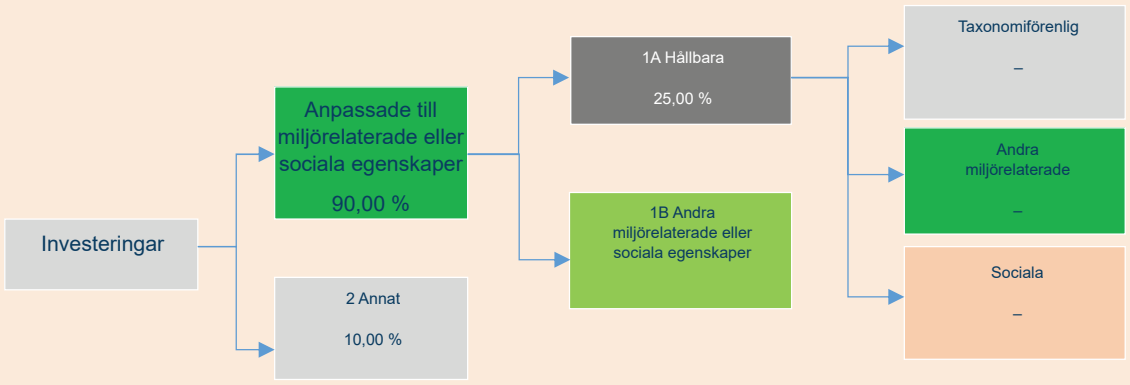
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 25 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[157]?***

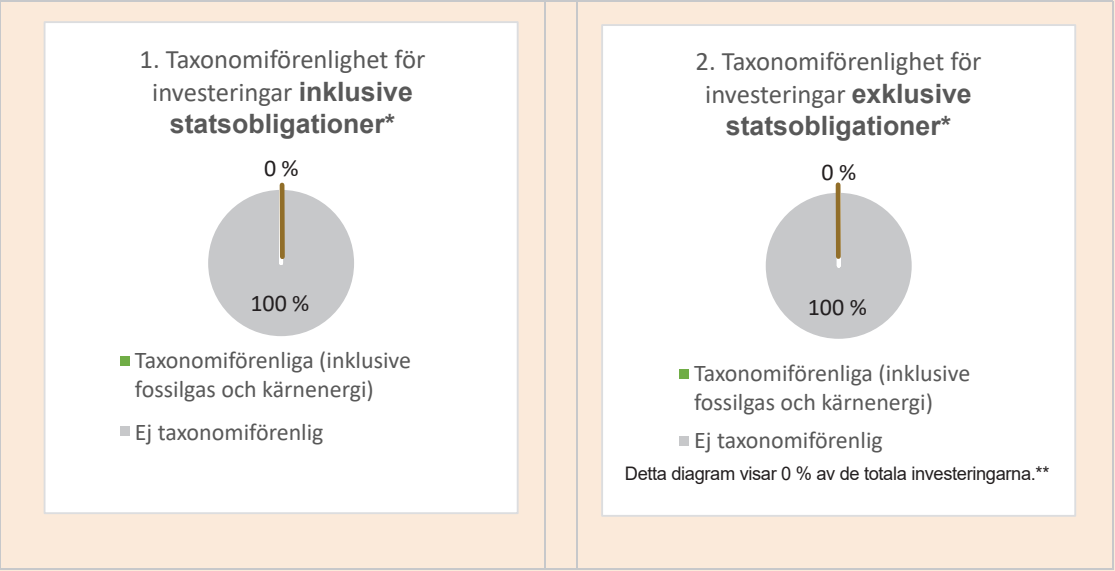
  - ☐ Ja:
    - ☐ I fossilgas
    - ☐ I kärnenergi
  - ☒ Nej

[157] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 25 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 25 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om den finansiella produkten överensstämmer med de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan den finansiella produktens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är baserat på ett investeringsområde med EMU-statsobligationer med standardmarknadsvärde och modifierade vikter för att övervikta de gröna obligationerna. Resultatet blir därför inte detsamma som moderindexets.

Närmare bestämt är Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index baserat på Euro Treasury 50bn Bond Index (”moderindexet”) och mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta denominerade i euro. Indexet har en inriktning så att minst 30 % av indexets marknadsvärde på en ombalanseringsdag är allokerat till värdepapper som klassificeras som gröna obligationer och resterande procentandel är allokerad till icke-gröna obligationer, och riskprofilerna för indexet och moderindexet är jämförbara.

Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?

Mer information om indexet finns på
https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
AMUNDI EURO GOVERNMENT LOW DURATION TILTED GREEN BOND

Identifieringskod för juridiska personer:
2138007Q9VS5HUGYMW48

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja**

☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 25 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index (”referensvärdet”), ett index för EMU-statsobligationer där de gröna obligationerna är överviktade med avseende på ett EMU-statsobligationsindex med standardmarknadsvärde.

Referensvärdet omfattar standardobligationer och gröna obligationer som är emitterade av EMU-stater. De obligationer som anses vara ”gröna obligationer” identifieras med hjälp av data från Bloomberg.

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index (”referensvärdet”), ett index för EMU-statsobligationer där de gröna obligationerna är överviktade med avseende på ett EMU-statsobligationsindex med standardmarknadsvärde.

Referensvärdet omfattar standardobligationer och gröna obligationer som är emitterade av EMU-stater. De obligationer som anses vara ”gröna obligationer” identifieras med hjälp av data från Bloomberg. De gröna obligationerna i indexet är obligationer vars nettoobligationsintäkter kommer att vara helt avsedda för grön verksamhet som accepteras på marknaden baserat på Bloombergs klassificering (till exempel men inte endast förnybar energi, energieffektivitet, gröna byggnader och annat). Se www.bloomberg.com för mer information om godtagbara projektkategorier.

De gröna obligationerna granskas av Bloomberg för att säkerställa att de uppfyller minimikriterierna för att klassificeras lämpligt. Kriterierna återspeglar principerna för gröna obligationer som inkluderar:
– användning av intäkter
– projekturvalsprocess
– hantering av intäkter
– rapportering.

Alla gröna obligationer granskas årligen för att bekräfta att intäkterna används för att stödja gröna projekt. Obligationer med intäkter som inte har bekräftats användas för gröna ändamål inom 18 månader efter den senaste granskningen tas bort från indexet. Obligationer med intäkter som har bekräftats inte användas för gröna ändamål tas också bort från indexet. Sådana värdepapper får ingå i moderindexet och förblir i indexet, men behandlas som icke-gröna obligationer, dvs. inkluderas inte i den totala vikten på 30 % gröna obligationer i indexet.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Bloomberg ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Bloomberg ESG-betygsmetoden använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot branschspecifika, betydande ESG-risker på lång sikt. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om Bloomberg ESG-betyg finns på Bloombergs webbplats:

Närmare bestämt uppfyller indexet följande kriterier:
–Obligationer från Bloomberg Euro Treasury 50bn 3-5 Bond Index måste ha minst 3, och upp till men inte inklusive, 5 års löptid kvar till förfallodagen
–Obligationer från Bloomberg Euro Treasury Green Bond 1M+ Select Country Index måste ha minst en månads löptid kvar till förfallodagen
–Godtagbara obligationer emitteras av stater som är medlemmar i den europeiska ekonomiska och monetära unionen: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien

–Värdepapperen måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre) enligt medelbetyget från Moody's, S&P och Fitch
–Den totala viktningen av gröna obligationer i indexet måste vara 30 %
–Kapital och ränta måste vara denominerade i euro
–Länder som klassificeras som ”inte fria” av Freedom House är uteslutna från indexet

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1. följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2. undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer. Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

För att betraktas som en hållbar investering måste ett företag uppfylla ovanstående mål och inte ha någon betydande exponering mot verksamheter som anses oförenliga med långsiktiga mål för hållbar utveckling (t.ex. koldioxidintensiv energiproduktion och -distribution, tobak, vapen, spel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk).

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslutets mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första filtret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn). – Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak. Dessutom anses företag och ekonomiska aktörer som exponeras för allvarliga kontroverser i samband med arbetsvillkor, mänskliga rättigheter, biologisk mångfald och föroreningar inte vara hållbara investeringar. Det andra filtret syftar till att verifiera att ett investeringsbolag inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Hos Amundi har indikatorerna för negativa konsekvenser beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
–ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
–ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
–bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
–bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Hos Amundi är OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

☒ Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier:

– Uteslutning: Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.

– Engagemang: Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen på, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
– Röstning: Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy.
– Övervakning av kontroverser: Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder. Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index kombinerar Bloomberg Euro Treasury 50bn 3-5 Bond Index med Bloomberg Euro Treasury Green Bond 1M+ Select Country Index, som mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta, som är denominerade i euro.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.
Indexet uppfyller följande kriterier:
–Obligationer från Bloomberg Euro Treasury 50bn 3-5 Bond Index måste ha minst 3, och upp till men inte inklusive, 5 års löptid kvar till förfallodagen
–Obligationer från Bloomberg Euro Treasury Green Bond 1M+ Select Country Index måste ha minst en månads löptid kvar till förfallodagen
–Godtagbara obligationer emitteras av stater som är medlemmar i den europeiska ekonomiska och monetära unionen: Österrike, Belgien, Finland, Frankrike, Tyskland, Irland, Italien, Nederländerna, Portugal och Spanien
–Värdepapperen måste ha höga kreditbetyg (Baa3/BBB-/BBB- eller högre) enligt medelbetyget från Moody's, S&P och Fitch
–Den totala viktningen av gröna obligationer i indexet måste vara 30 %
–Kapital och ränta måste vara denominerade i euro
–Länder som klassificeras som ”inte fria” av Freedom House är uteslutna från indexet
Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

För att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten förlitar vi oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi. Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Varje värdepapper i företag (aktier, obligationer, derivat som refererar till ett namn, ESG-aktier och räntebärande börshandlade fonder) som ingår i investeringsportföljer har bedömts beträffande praxis för god styrning genom att tillämpa ett normativt urval mot FN:s Global Compact-principer för den aktuella emittenten. Bedömningen görs löpande. Amundis ESG-betygskommitté granskar varje månad listor över företag som bryter mot FN:s Global Compact, vilket leder till att betyg nedgraderas till G. Avyttring av värdepapper som nedgraderats till G utförs som standard inom 90 dagar.

Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

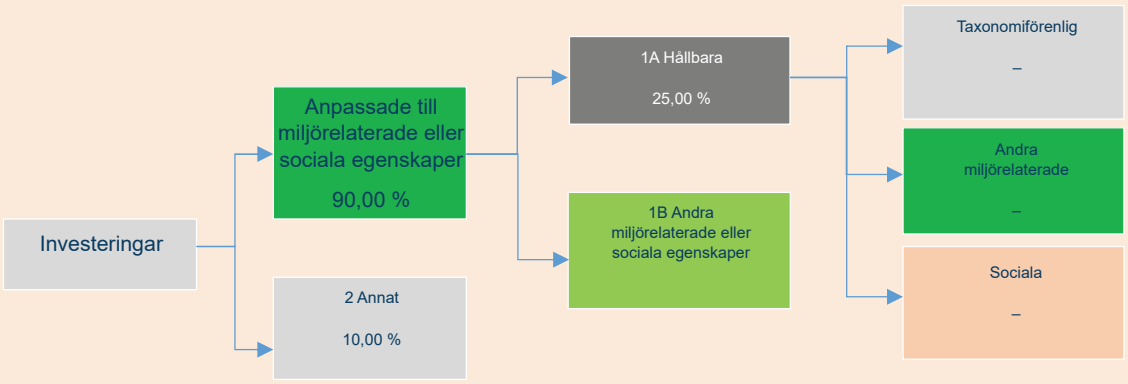
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 25,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

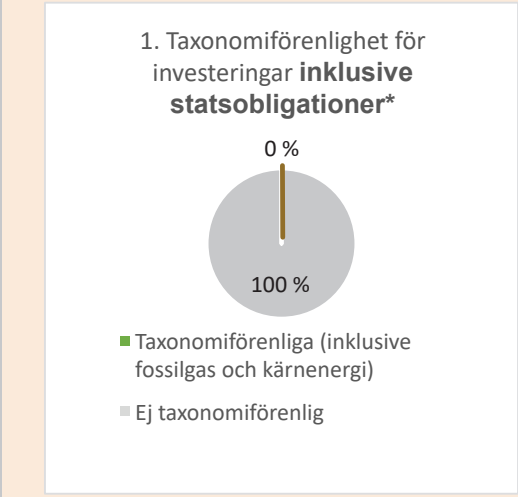
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

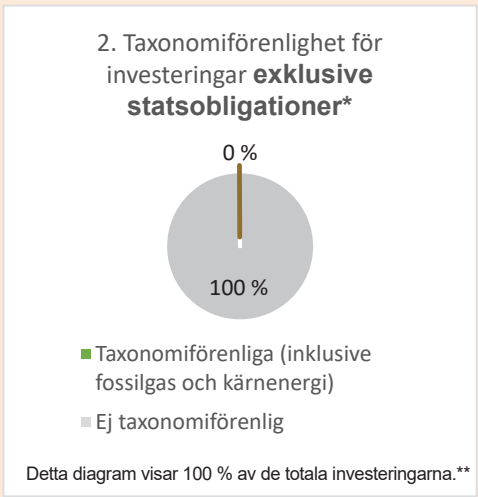
- ***Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[158]?***

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

- ***Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?***

Fonderna har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[158] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 25 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 25 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Det finns inga lägsta miljömässiga eller sociala garantier.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Ja, Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?

Bloomberg Euro Treasury Low Duration Green Bond Tilted Index kombinerar Bloomberg Euro Treasury 50bn 3-5 Bond Index med Bloomberg Euro Treasury Green Bond 1M+ Select Country Index, som mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta, som är denominerade i euro.

Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?

Mer information om indexet finns på: https://www.bloomberg.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi MSCI Europe Screened

Identifieringskod för juridiska personer:
2138002M64WR7C3EIW07

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

☐ **Ja** ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 25,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat replikera ett index som integrerar ett betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (”ESG”).

Indexmetoden är anpassad till vissa kriterier, till exempel:
i. Uteslutning av vissa aktiviteter baserat på ESG-kriterier: tobak, kontroversiella vapen, civila skjutvapen, utvinning av olja och gas i Arktis, palmolja, energikolreserver och elproduktion från energikol. Dessutom utesluts företag som har identifierats vara involverade i ESG-kontroverser eller inte följer FN:s Global Compact-principer från indexet, baserat på betyg och trösklar definierade av MSCI.

ii. En minsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till moderindexet på 30 %.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

MSCI ESG-betyget används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

MSCI:s metodik för ESG-betyg använder en regelbaserad metod som är utformad för att mäta ett företags motståndskraft mot långsiktiga ESG-risker som är väsentliga för branschen. Den baseras på icke-finansiella ESG-nyckelfrågor som fokuserar på skärningspunkten mellan ett företags kärnverksamhet och branschspecifika frågor som kan skapa betydande risker och möjligheter för företaget. ESG-nyckelfrågorna viktas efter riskens eller möjlighetens inverkan och tidshorisont. ESG-nyckelfrågorna är till exempel, men är inte begränsade till, vattenstress, koldioxidutsläpp, arbetsledning eller affärsetik.

Närmare information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf.

Närmare information om MSCI ESG-kontroversbetyg finns på följande länk:
https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Närmare bestämt omfattar det tillämpliga investeringsområdet alla värdepapper i moderindexet.

Indexets beståndsdelar väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet.
i. Först och främst exkluderas värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt företagsaktivitet som inkluderar kontroversiella vapen, civila skjutvapen, tobak, elproduktion från energikol, energikolreserver och/eller utvinning av olja och gas i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser och tillsammans med företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter.
ii. Dessutom tillämpar MSCI på det kvarvarande investeringsområdet en iterativ process med syfte att nå en minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet. Om minskningen av växthusgaser på 30 % jämfört med moderindexet inte nås tillämpas följande iterativa process:
1. Värdepapperen rangordnas i fallande ordning baserat på växthusgasintensitet.
2. Värdepapperet med högsta växthusgasintensitet utesluts och resulterande index jämförs med moderindexet för att avgöra om 30 % minskning av växthusgasintensitet har uppnåtts.
3. Om minskningen har uppnåtts behövs inga ytterligare värdepapper. Om minskningen inte har uppnåtts utesluts ytterligare värdepapper enligt steg 1 och 2 tills minskningen på 30 % har uppnåtts.

De återstående värdepapperen viktas sedan för det justerade fria omsättningsbara börsvärdet.

*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer. Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Genom att tillämpa Amundis ovan beskrivna definition av hållbar investering på indexkomponenterna i denna passivt förvaltade ETF-produkt har Amundi fastställt att denna produkt har den minimiandel hållbara investeringar som anges på sidan 1 ovan. Observera dock att Amundis definition av hållbara investeringar inte införts på indexmetodnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter: Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:

– ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
– ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
– bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
– bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier.

– Uteslutning: Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
– Engagemang: Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala
dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
– Röstning: Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy.
– Övervakning av kontroverser: Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad.
Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.
Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

[ ] Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för MSCI Europe Screened ex-Thermal Coal Index (”indexet”) och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 15 länder med utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter också företaget från moderindexet baserat på ESG-kriterier (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Indexet har som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Detta är en passivt förvaltad börshandlad fond.
Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.
Indexets beståndsdelar väljs ut genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en iterativ process för att minska koldioxidintensiteten jämfört med moderindexet.
–Först och främst exkluderas värdepapper från företag som enligt MSCI ESG Research* ägnar sig åt företagsaktivitet som inkluderar kontroversiella vapen, civila skjutvapen, tobak, elproduktion från energikol, energikolreserver och/eller utvinning av olja och gas i Arktis, tillsammans med företag som klassificerats med ”röd flagg” gällande MSCI ESG-kontroverser** och ”orange flagg” gällande MSCI ESG-miljökontroverser och tillsammans med företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter.
–Dessutom tillämpar MSCI på det kvarvarande investeringsområdet en iterativ process med syfte att nå en minskning av koldioxidavtrycket med 30 % jämfört med moderindexet. Om minskningen av växthusgaser på 30 % jämfört med moderindexet inte nås tillämpas följande iterativa process:
1. Värdepapperen rangordnas i fallande ordning baserat på växthusgasintensitet.
2. Värdepapperet med högsta växthusgasintensitet utesluts och resulterande index jämförs med moderindexet för att avgöra om en 30 % minskning av växthusgasintensitet har uppnåtts.
3. Om minskningen har uppnåtts behövs inga ytterligare värdepapper.
Om minskningen inte har uppnåtts utesluts ytterligare värdepapper enligt steg 1 och 2 tills minskningen på 30 % har uppnåtts.
De återstående värdepapperen viktas sedan för det justerade fria omsättningsbara börsvärdet.
*Se indexmetoden som finns på msci.com för mer information om affärsverksamheterna och urvalet.
**MSCI ESG-kontroverser ger bedömningar av kontroverser beträffande negativ påverkan på miljön, sociala frågor och/eller bolagsstyrningen av företagets verksamhet, produkter och tjänster.
Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- ***Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?***

Ingen minimiandel.

- ***Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att emittenten uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt) De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi.

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.



Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

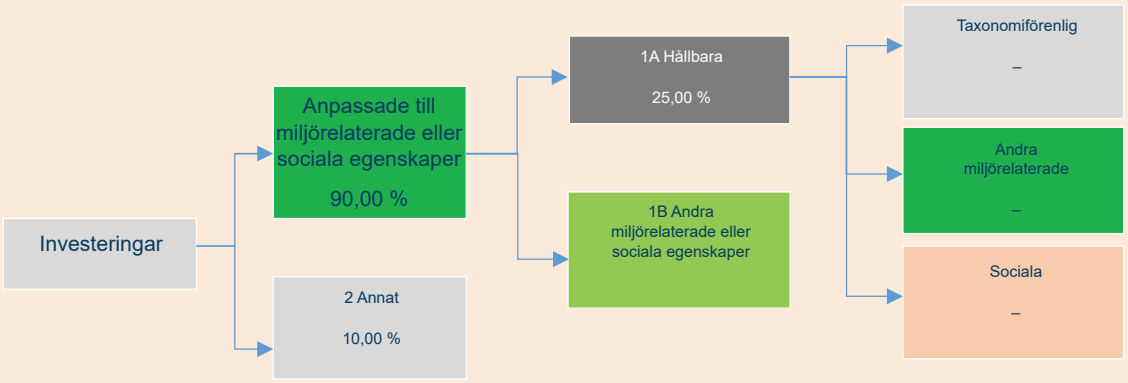
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 25,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

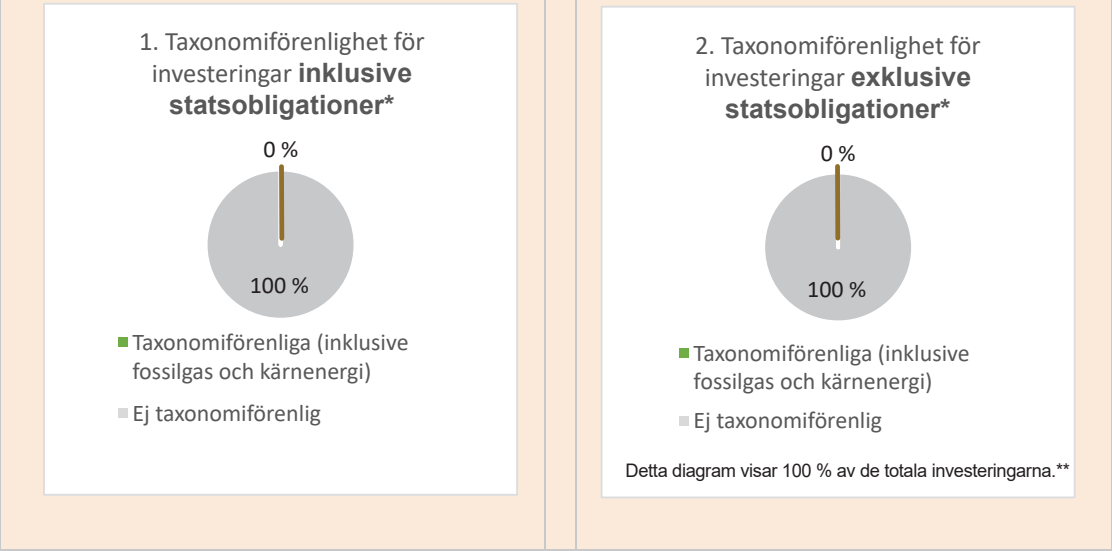
Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[159]?

☐ Ja:
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
☒ Nej

[159] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställnings-verksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 25 % hållbara investeringar utan att förbinda sig till ett miljömål som anges i denna bilaga och utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden kommer att ha minst 25 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot en lägsta andel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Ja, indexet har valts som referensvärde för att fastställa om delfonden överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsorer (inklusive BMR) bör indexsponsorer definiera lämpliga kontroller när indexmetoder för reglerade index definieras och/eller används.

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Delfondens investeringsmål är att följa indexets utveckling både uppåt och nedåt och samtidigt minimera skillnaden mellan delfondens avkastning och indexets avkastning.

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Indexet är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index (”moderindexet”), som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 15 länder med utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter också företaget från moderindexet baserat på ESG-kriterier (miljö, sociala frågor och bolagsstyrning). Indexet har som mål att nå 30 % minskning av koldioxidintensitet jämfört med moderindexet.

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på: www.MSCI.com



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Produktnamn:
Amundi EUR Cash Active

Identifieringskod för juridiska personer:
213800GNZ7UL42K1JN28

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- [ ] **Ja**
- [x] **Nej**

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- [x] Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar
  - [ ] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [x] med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
  - [ ] med ett socialt mål

- [ ] Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%
- [ ] Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat sträva efter att ha ett högre ESG-betyg än investeringsområdet. Vid fastställandet av delfondens ESG-betyg och investeringsområdet bedöms ESG-resultat genom att jämföra ett värdepappers genomsnittliga resultat med emittentens bransch, med avseende på var och en av de tre ESG-egenskaperna miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning. För denna mätning definieras investeringsområdet som ICE BOFA 1-3 YEAR GLOBAL CORPORATE Index (”investeringsområdet”). Inget ESG-referensindex har valts.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den hållbarhetsindikator som används är delfondens ESG-betyg som mäts mot ESG-betyget för delfondens investeringsområde.

Amundi har utvecklat en egen ESG-betygsprocess som bygger på ”bäst i klassen”. Betygen är anpassade till varje verksamhetssektor och strävar efter att bedöma den dynamik i vilken företagen verkar. Amundis ESG-betyg är en kvantitativ ESG-poäng som översatts till sju betyg, från A (det högsta betyget) till G (det lägsta betyget). På Amundis ESG-betygsskala motsvarar de värdepapper som hör till uteslutningslistan ett G. För företagsemittenter bedöms ESG-resultat globalt och på aktuell kriterienivå genom jämförelse med det genomsnittliga resultatet för branschen genom en kombination av de tre ESG-dimensionerna:
– Miljödimension: Denna undersöker en emittents förmåga att kontrollera sin direkta och indirekta miljöpåverkan genom att begränsa sin energiförbrukning, minska sina växthusgasutsläpp, bekämpa resursutarmning och skydda den biologiska mångfalden.
– Social dimension: Denna mäter hur en emittent använder sig av två skilda koncept: emittentens strategi för att utveckla sitt humankapital och respekten för de mänskliga rättigheterna i allmänhet.
– Bolagsstyrningsdimension: Denna bedömer emittentens förmåga att säkerställa grunden för en effektiv bolagsstyrningsram och generera värde på lång sikt.

Den metod som tillämpas av Amundis ESG-betyg använder 38 kriterier som antingen är generiska (gemensamma för alla företag oavsett deras verksamhetstyp) eller sektorspecifika som är viktade enligt sektor och som beaktas i fråga om inverkan på en emittents anseende, operativa effektivitet och bestämmelser. Amundis ESG-betyg kommer sannolikt att uttryckas globalt för de tre dimensionerna E, S och G eller individuellt för en miljöfaktor eller social faktor.

Mer information om ESG-betyg och kriterier finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Hos Amundi är målen för hållbara investeringar att investera i företag eller ekonomiska aktörer vars affärsmodell och verksamhet bidrar till att stödja positiva miljö- eller sociala mål genom att uppfylla två kriterier:

1. följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2. undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsföretaget eller den ekonomiska aktören ska anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För hälso- och sjukvårdssektorn är till exempel dessa väsentliga faktorer utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, arbetsförhållanden, produkt- och kundansvar, samhällsengagemang och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier.

En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

- ***På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn).

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?

Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan: Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
–ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
–ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
–bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
–bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[X] Ja, delfonden beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för delfondens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier.

–Uteslutning: Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.

–Integration av ESG-faktorer: Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har även utformats för att beakta viktiga konsekvenser för hållbarhetsfaktorer samt kvaliteten på de åtgärder som vidtagits

–Engagemang: Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.

–Röstning: Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy.

– Övervakning av kontroverser: Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

☐ Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Mål:
Delfonden är en aktivt förvaltad börshandlad fondföretagsfond som strävar efter att ge en avkastning i linje med penningmarknadsräntan.

Investering:
Delfonden investerar minst 67 % av nettotillgångarna i ett brett urval av tillgångar som följer förordningen om penningmarknadsfonder och kan i synnerhet investera i obligationer, penningmarknadsinstrument med hög kreditkvalitet, insättningar hos kreditinstitut från offentliga och privata emittenter, penningmarknadslån med tillgångar som säkerhet (ABCP-papper), denominerade i euro eller säkrade mot euro.
Delfonden investerar högst 30 % av tillgångarna i penningmarknadsinstrument som emitterats eller garanterats av en stat, en lokal myndighet inom EU eller ett internationellt organ där minst ett EU-land är medlem.

Den vägda genomsnittliga löptiden i delfondens portfölj är 180 dagar och den vägda genomsnittliga livslängden är 365 dagar.
Delfonden kan även investera upp till 10 % av nettotillgångarna i andelar i andra penningmarknadsfonder.

Jämförelseindex:
Delfonden förvaltas aktivt och strävar efter att nå stabila resultat i linje med den korta euroräntan. Delfonden kan i efterhand använda jämförelseindexet som en indikator för att bedöma delfondens resultat. Det finns inga begränsningar relaterade till jämförelseindexet som inskränker portföljsammansättningen.

Förvaltningsprocess:
Delfonden integrerar hållbarhetsfaktorer i investeringsprocessen som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbar investering” i prospektet. Investeringsförvaltaren förvaltar delfonden aktivt och använder en strategi som införlivar både teknisk och fundamental analys, inklusive kreditanalys. Denna metod vägleder urvalet av kvalitetsemittenter och kortfristiga värdepapper med målet att sätta samman en portfölj av hög kvalitet med ett starkt fokus på likviditet och riskhantering. Delfonden strävar efter att portföljens ESG-betyg ska vara högre än investeringsområdets ESG-betyg.

Investerings-strategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Alla värdepapper som innehas i delfonden omfattas av ESG-kriterierna. Detta uppnås genom användningen av Amundis egenutvecklade metod och/eller tredje parts ESG-information.

Delfonden tillämpar först Amundis uteslutningspolicy inklusive följande regler:
– rättsliga uteslutningar av kontroversiella vapen (truppminor, klusterbomber, kemiska vapen, biologiska vapen osv.)
– företag som allvarligt och upprepade gånger bryter mot en eller flera av de 10 principerna i FN:s globala överenskommelse, utan trovärdiga korrigerande åtgärder
– Amundi-koncernens sektorsuteslutningar (närmare uppgifter om denna policy finns i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar som finns på webbplatsen www.amundi.lu).

Delfonden strävar som ett bindande element efter att ha ett högre ESG-betyg än investeringsområdet.

Delfondens ESG-kriterier tillämpas på minst:
– 90 % av värdepapper som emitterats av företag med stort börsvärde i utvecklade länder, skuldförbindelser, penningmarknadsinstrument med höga kreditbetyg och statspapper som emitterats av utvecklade länder
– 75 % av värdepapper som emitterats av företag med stort börsvärde i tillväxtmarknadsländer, aktier som emitterats av företag med litet och medelstort börsvärde i valfria länder, skuldförbindelser och penningmarknadsinstrument med höga kreditbetyg och statspapper som emitterats av tillväxtmarknadsländer.

Investerarna bör dock notera att det kanske inte är genomförbart att utföra ESG-analys på kontanta medel, vissa derivat och vissa företag för kollektiva investeringar till samma standarder som för andra investeringar. Metoden för ESG-beräkning inkluderar inte värdepapper som inte har ett ESG-betyg och inte heller kontanta medel, vissa derivat och vissa företag för kollektiva investeringar.

Med beaktande av minimiåtagandet på 5 % i hållbara investeringar med ett miljömål investerar delfonden dessutom i investeringsobjekt som anses ”prestera bäst” med ett av de tre bästa betygen (A, B eller C på en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor på minst en väsentlig miljöfaktor eller social faktor.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi

Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

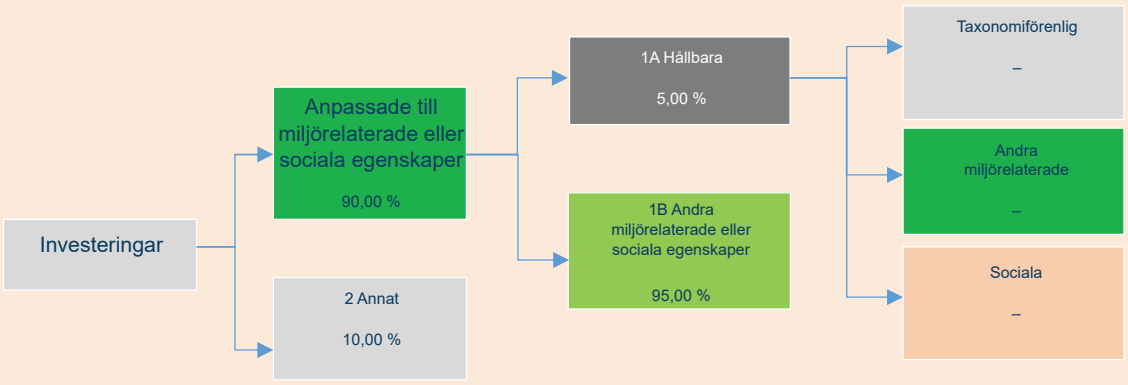
Minst 90,00 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5,00 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram. Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (#1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (#1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gaseller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[160]?

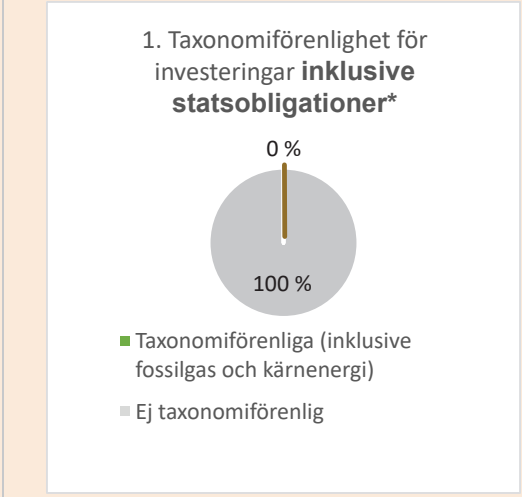
☐ Ja:

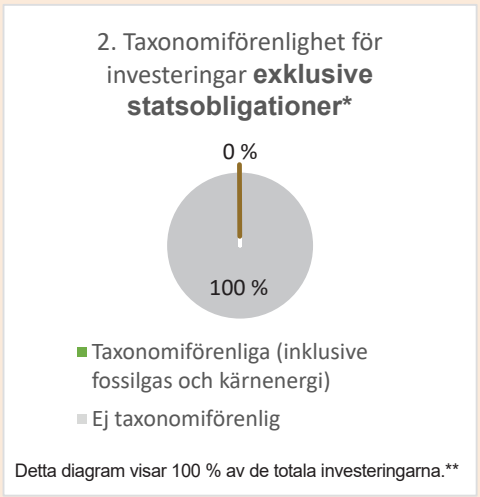
☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.





**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Fonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[160] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden har ingen minimiandel socialt hållbara investeringar.

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Denna delfond har inte valt ett specifikt index som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Inte tillämpligt

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Inte tillämpligt

- ***Hur skiljer sig det valda referensvärdet från ett relevant brett marknadsindex?***

Inte tillämpligt

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Inte tillämpligt

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Inte tillämpligt



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com

Mallen för upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn:
Amundi USD Cash Active

Identifieringskod för juridiska personer:

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering avser en investering i en ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificationssystem som fastställs i förordning (EU) 2020/852, som upprättar en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.** Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

- ●● ☐ **Ja**
- ●○ ☒ **Nej**

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål:** _____%

- ☐ i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

☒ Den **främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte har hållbar investering som sitt mål kommer den att ha en minimiandel på 5,00 % hållbara investeringar

- ☐ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☒ med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin
- ☐ med ett socialt mål

☐ Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål:** _____%

☐ Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Delfonden främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper genom att bland annat sträva efter att ha ett högre ESG-betyg än investeringsområdet. Vid fastställandet av delfondens ESG-betyg och investeringsområdet bedöms ESG-resultat genom att jämföra ett värdepappers genomsnittliga resultat med emittentens bransch, med avseende på var och en av de tre ESG-egenskaperna miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning. För denna mätning definieras investeringsområdet som ICE BOFA 1-3 YEAR GLOBAL CORPORATE Index (”investeringsområdet”). Inget ESG-referensindex har valts.

Hållbarhetsindikatorer mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

- ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Den hållbarhetsindikator som används är delfondens ESG-betyg som mäts mot ESG-betyget för delfondens investeringsområde.

Amundi har utvecklat en egen ESG-betygsprocess som bygger på ”bäst i klassen”. Betygen är anpassade till varje verksamhetssektor och strävar efter att bedöma den dynamik i vilken företagen verkar.

Amundis ESG-betyg är en kvantitativ ESG-poäng som översatts till sju betyg, från A (det högsta betyget) till G (det lägsta betyget). På Amundis ESG-betygsskala motsvarar de värdepapper som hör till uteslutningslistan ett G. För företagsemittenter bedöms ESG-resultat globalt och på aktuell kriterienivå genom jämförelse med det genomsnittliga resultatet för branschen genom en kombination av de tre ESG-dimensionerna:
–Miljödimension: Denna undersöker en emittents förmåga att kontrollera sin direkta och indirekta miljöpåverkan genom att begränsa sin energiförbrukning, minska sina växthusgasutsläpp, bekämpa resursutarmning och skydda den biologiska mångfalden.
– Social dimension: Denna mäter hur en emittent använder sig av två skilda koncept: emittentens strategi för att utveckla sitt humankapital och respekten för de mänskliga rättigheterna i allmänhet.
–Bolagsstyrningsdimension: Denna bedömer emittentens förmåga att säkerställa grunden för en effektiv bolagsstyrningsram och generera värde på lång sikt.
Den metod som tillämpas av Amundis ESG-betyg använder 38 kriterier som antingen är generiska (gemensamma för alla företag oavsett deras verksamhetstyp) eller sektorspecifika som är viktade enligt sektor och som beaktas i fråga om inverkan på en emittents anseende, operativa effektivitet och bestämmelser. Amundis ESG-betyg kommer sannolikt att uttryckas globalt för de tre dimensionerna E, S och G eller individuellt för en miljöfaktor eller social faktor.
Mer information om ESG-betyg och kriterier finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

- ***Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?***

Målen med hållbar investering är att investera i investeringsobjekt som strävar efter att uppfylla två kriterier:

1) följa bästa miljömässiga och sociala praxis
2) undvika att tillverka produkter eller tillhandahålla tjänster som skadar miljön och samhället.

För att investeringsobjektet ska kunna anses bidra till ovanstående mål måste det ”prestera bäst” inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.
Definitionen av att ”prestera bäst” grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses ”prestera bäst” måste ett investeringsobjekt ha ett av de tre bästa betygen (A, B eller C, från en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor i minst en väsentlig miljömässig eller social faktor. Väsentliga miljömässiga och sociala faktorer identifieras på sektornivå. Identifieringen av väsentliga faktorer baseras på Amundis ESG-analysram som kombinerar icke-finansiella data och kvalitativ analys av tillhörande sektors- och hållbarhetsteman. Faktorer som identifierats som väsentliga resulterar i ett bidrag på mer än 10 % till det totala ESG-betyget. För energisektorn är till exempel väsentliga faktorer: utsläpp och energi, biologisk mångfald och föroreningar, hälsa och säkerhet, lokala samhällen och mänskliga rättigheter. En mer fullständig översikt över sektorer och faktorer finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu

För att bidra till ovanstående mål bör investeringsobjektet inte ha en betydande exponering mot verksamheter (t.ex. tobak, vapen, hasardspel, kol, luftfart, köttproduktion, tillverkning av gödningsmedel och bekämpningsmedel, tillverkning av plast för engångsbruk) som inte är förenliga med sådana kriterier. En investerings hållbarhet bedöms på investeringsobjektsnivå.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbeslut mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar, som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:
Det första testfiltret om att inte orsaka betydande skada grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga (t.ex. investeringsobjekts växthusgasintensitet) genom en kombination av indikatorer (t.ex. koldioxidintensitet) och specifika tröskelvärden eller regler (t.ex. att investeringsobjektets koldioxidintensitet inte tillhör den sista decilen i sektorn). Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol och tobak.

Utöver de specifika hållbarhetsfaktorer som omfattas av det första filtret har Amundi definierat ett andra filter, som inte beaktar de obligatoriska indikatorerna för huvudsakliga negativa konsekvenser ovan, för att verifiera att företaget inte presterar dåligt ur en övergripande miljömässig eller social synvinkel jämfört med andra företag inom sektorn som motsvarar ett miljömässigt eller socialt betyg som är högre eller lika med E med Amundis ESG-betyg.

- ***Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?***

  Indikatorerna för negativa konsekvenser har beaktats enligt vad som beskrivs i det första filtret om att inte orsaka betydande skada ovan:
  Det första filtret grundas på övervakning av obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser i bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn, där robusta data finns tillgängliga genom kombinationen av följande indikatorer och specifika tröskelvärden eller regler:
  - ha en koldioxidintensitet som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn (gäller endast högintensiva sektorer)
  - ha en mångfald inom styrelsen som inte tillhör den sista decilen jämfört med andra företag inom sektorn
  - bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter
  - bli rentvådd från eventuella kontroverser beträffande biologisk mångfald och föroreningar.

  Amundi beaktar redan specifika huvudsakliga negativa konsekvenser inom sin uteslutningspolicy som en del av Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Dessa uteslutningar, som gäller utöver de tester som beskrivs ovan, omfattar följande teman: uteslutningar på grund av kontroversiella vapen, brott mot FN:s Global Compact-principer, kol, okonventionella fossila bränslen och tobak.

- ***Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter?*** *Beskrivning:*

OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter är integrerade i vår ESG-betygsmetod. Vårt egenutvecklade ESG-betygsverktyg bedömer emittenter med hjälp av tillgängliga data från våra dataleverantörer. Modellen har till exempel ett särskilt kriterium som kallas ”samhällsengagemang och mänskliga rättigheter” som tillämpas på alla sektorer utöver andra kriterier som är kopplade till mänskliga rättigheter, inklusive socialt ansvarsfulla leverantörskedjor, arbetsförhållanden och arbetsrelationer. Dessutom genomför vi en övervakning av kontroverser åtminstone kvartalsvis, vilket inkluderar företag som identifierats för brott mot de mänskliga rättigheterna. När kontroverser uppstår utvärderar analytiker situationen och tillämpar ett betyg på kontroversen (med hjälp av vår egen betygsmetod) och fastställer det bästa tillvägagångssättet. Kontroversbetyg uppdateras kvartalsvis för att följa trenderna och åtgärderna.

I EU-taxonomin fastställs en princip om att ”inte orsaka betydande skada”, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att ”inte orsaka betydande skada” är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

[x] Ja, den finansiella produkten beaktar de huvudsakliga negativa konsekvenserna enligt bilaga 1, tabell 1 i de tekniska standarderna för tillsyn som gäller för den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), engagemang och röstningsstrategier

- **Uteslutning:** Amundi har definierat normativa, verksamhetsbaserade och sektorbaserade uteslutningsregler som täcker några av de viktigaste negativa hållbarhetsindikatorer som anges i förordningen om hållbarhetsupplysningar.
- **Integration av ESG-faktorer:** Amundi har antagit minimistandarder för ESG-integration som standard för sina aktivt förvaltade öppna fonder (uteslutning av emittenter med betyget G och bättre viktat genomsnittligt ESG-värde som är högre än det tillämpliga jämförelseindexet). De 38 kriterier som används i Amundis ESG-betygsmetod har också utformats för att ta hänsyn till viktig påverkan på hållbarhetsfaktorer, liksom kvaliteten på de åtgärder som vidtagits.
- **Engagemang:** Engagemang är en kontinuerlig och ändamålsenlig process som syftar till att påverka investeringsobjektens verksamhet eller beteende. Syftet med engagemangsåtgärderna kan delas in i två kategorier: att förmå en emittent att förbättra sättet som den integrerar den miljömässiga och sociala dimensionen, att förmå en emittent att förbättra sin inverkan på miljö, sociala frågor och mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är väsentliga för samhället och den globala ekonomin.
- **Röstning:** Amundis röstningspolicy reagerar på en helhetsanalys av alla långsiktiga frågor som kan påverka värdeskapandet, inklusive väsentliga ESG-frågor. Mer information finns i Amundis röstningspolicy[161].

161 https://about.amundi.com/files/nuxeo/dl/0522366c-29d3-471d-85fd-7ec363c20646

– **Övervakning av kontroverser:** Amundi har utvecklat ett system för att följa kontroverser som förlitar sig på tre externa dataleverantörer för att systematiskt följa kontroverser och deras allvarlighetsgrad. Denna kvantitativa metod kompletteras sedan med en fördjupad bedömning av varje allvarlig kontrovers, ledd av ESG-analytiker och den periodiska granskningen av dess utveckling. Denna metod gäller för alla Amundis fonder.

Alla uppgifter om hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används finns i Amundis ESG Regulatory Statement på www.amundi.lu.

☐ Nej



Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Mål: Delfonden är en aktivt förvaltad börshandlad fondföretagsfond som strävar efter att ge en avkastning i linje med penningmarknadsräntan Investering: Delfonden investerar minst 67 % av nettotillgångarna i ett brett urval av tillgångar som följer förordningen om penningmarknadsfonder och kan i synnerhet investera i obligationer, penningmarknadsinstrument med hög kreditkvalitet, insättningar hos kreditinstitut från offentliga och privata emittenter, penningmarknadslån med tillgångar som säkerhet (ABCP-papper), denominerade i USD eller säkrade mot USD.
Delfonden investerar högst 30 % av tillgångarna i penningmarknadsinstrument som emitterats eller garanterats av en stat, en lokal myndighet inom EU eller ett internationellt organ där minst ett EU-land är medlem.

Den vägda genomsnittliga löptiden i delfondens portfölj är 180 dagar och den vägda genomsnittliga livslängden är 365 dagar.
Delfonden kan även investera upp till 10 % av nettotillgångarna i andelar i andra penningmarknadsfonder.

Jämförelseindex: Delfonden förvaltas aktivt och strävar efter att nå stabila resultat i linje med den amerikanska styrräntan (”jämförelseindexet”). Delfonden kan i efterhand använda jämförelseindexet som en indikator för att bedöma delfondens resultat. Det finns inga begränsningar relaterade till jämförelseindexet som inskränker portföljsammansättningen.

Förvaltningsprocess: Delfonden integrerar hållbarhetsfaktorer i investeringsprocessen som beskrivs närmare i avsnittet ”Hållbar investering” i prospektet. Investeringsförvaltaren förvaltar delfonden aktivt och använder en strategi som införlivar både teknisk och fundamental analys, inklusive kreditanalys. Denna metod vägleder urvalet av kvalitetsemittenter och kortfristiga värdepapper med målet att sätta samman en portfölj av hög kvalitet med ett starkt fokus på likviditet och riskhantering. Delfonden strävar efter att portföljens ESG-betyg ska vara högre än investeringsområdets ESG-betyg.

Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

Alla värdepapper som innehas i delfonden omfattas av ESG-kriterierna. Detta uppnås genom användningen av Amundis egenutvecklade metod och/eller tredje parts ESG-information.
Delfonden tillämpar först Amundis uteslutningspolicy inklusive följande regler:
– rättsliga uteslutningar av kontroversiella vapen (truppminor, klusterbomber, kemiska vapen, biologiska vapen osv.)
– företag som allvarligt och upprepade gånger bryter mot en eller flera av de 10 principerna i FN:s globala överenskommelse, utan trovärdiga korrigerande åtgärder

– Amundi-koncernens sektorsuteslutningar (närmare uppgifter om denna policy finns i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar som finns på webbplatsen www.amundi.lu).
Delfonden strävar som ett bindande element efter att ha ett högre ESG-betyg än investeringsområdet.
Delfondens ESG-kriterier tillämpas på minst:
– 90 % av värdepapper som emitterats av företag med stort börsvärde i utvecklade länder, skuldförbindelser, penningmarknadsinstrument med höga kreditbetyg och statspapper som emitterats av utvecklade länder
– 75 % av värdepapper som emitterats av företag med stort börsvärde i tillväxtmarknadsländer, aktier som emitterats av företag med litet och medelstort börsvärde i valfria länder, skuldförbindelser och penningmarknadsinstrument med höga kreditbetyg och statspapper som emitterats av tillväxtmarknadsländer.
Investerarna bör dock notera att det kanske inte är genomförbart att utföra ESG-analys på kontanta medel, vissa derivat och vissa företag för kollektiva investeringar till samma standarder som för andra investeringar. Metoden för ESG-beräkning inkluderar inte värdepapper som inte har ett ESG-betyg och inte heller kontanta medel, vissa derivat och vissa företag för kollektiva investeringar.
Med beaktande av minimiåtagandet på 5 % i hållbara investeringar med ett miljömål investerar delfonden dessutom i investeringsobjekt som anses ”prestera bäst” med ett av de tre bästa betygen (A, B eller C på en betygsskala som går från A till G) inom sin sektor på minst en väsentlig miljöfaktor eller social faktor.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades?

Ingen minimiandel har åtagits för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades.

Vilken är policyn för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygsmetod. Amundis ESG-betyg baseras på en egenutvecklad ram för ESG-analys, som står för 38 allmänna och sektorspecifika kriterier, inklusive bolagsstyrningskriterier. I bolagsstyrningsdimensionen bedömer vi en emittents förmåga att säkerställa en effektiv ram för bolagsstyrning som garanterar att den uppfyller sina långsiktiga mål (t.ex. att garantera emittentens värde på lång sikt). De underkriterier för bolagsstyrning som beaktas är: styrelsestruktur, revision och kontroll, ersättning, aktieägares rättigheter, etik, skattepraxis och ESG-strategi Amundis ESG-betygsskala innehåller sju betyg, från A till G, där A är det bästa och G det sämsta betyget. Företag med betyget G är uteslutna från vårt investeringsområde.

Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

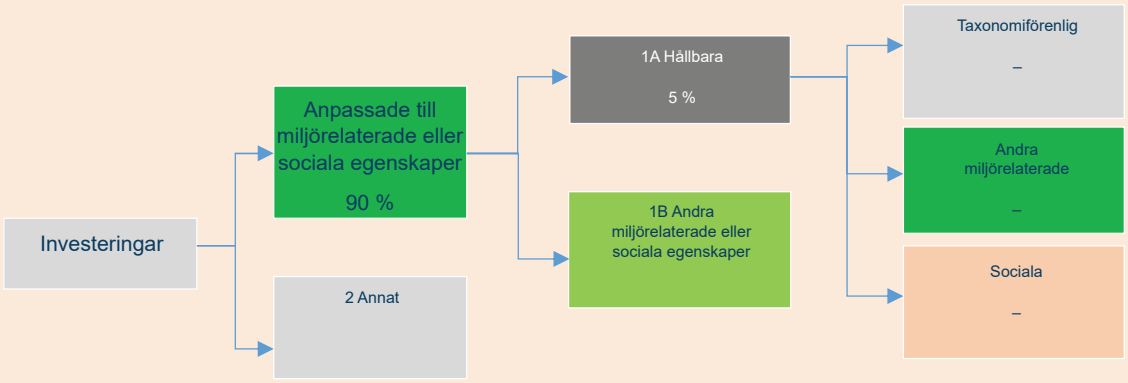
Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument uppfyller de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden.
Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 5 % hållbara investeringar utan åtagande att sträva mot miljö- eller sociala mål enligt nedanstående diagram.
Investeringar som är anpassade till andra miljörelaterade eller sociala egenskaper (1B) kommer att utgöra skillnaden mellan den faktiska andelen investeringar som är anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper (Nr 1) och den faktiska andelen hållbara investeringar (Nr 1A).

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

– omsättning, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter

– kapitalutgifter, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi

– driftsutgifter, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses vara hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:
– Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.
– Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar som är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

Det finns för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin.

Det finns inget åtagande att göra taxonomiförenliga investeringar i fossilgas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan dock investeringar göras i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin[162]?

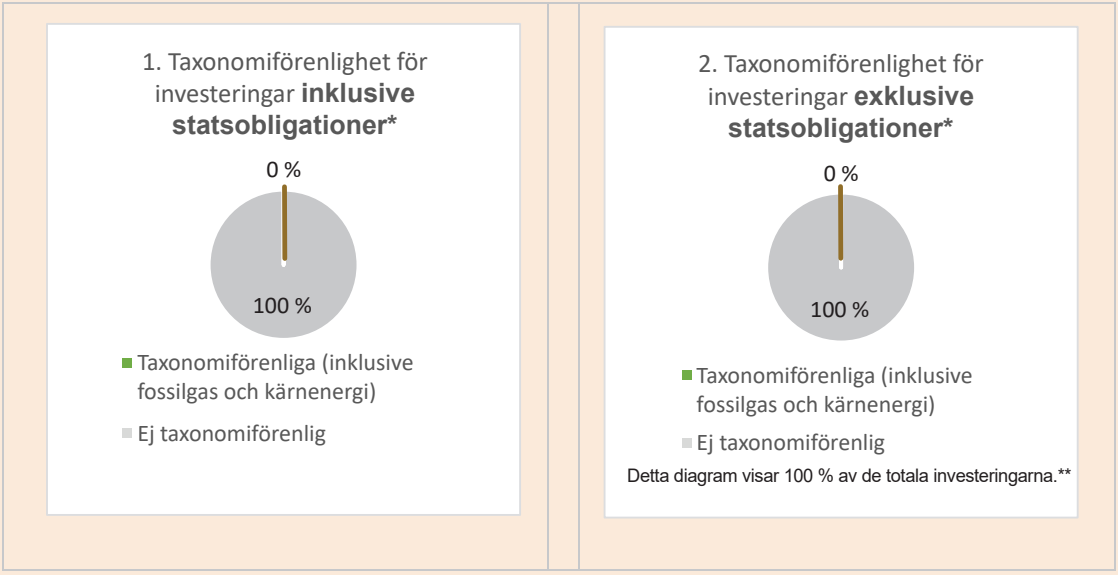
☐ Ja:

☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi

☒ Nej

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.
Omställningsverksamheter är- verksamheter som det ännu inte finns alternativ med låga koldioxidutsläpp tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa resultat.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statliga obligationer är, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar i statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på den finansiella produkten som inte inbegriper statliga obligationer.



**I dessa diagram avser statsobligationer samtliga statliga exponeringar*
***Denna procentsats är endast vägledande och kan variera.*

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

Delfonden har ingen minimiandel investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[162] Fossilgas- och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna (”begränsning av klimatförändringarna”) och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.

är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Delfonden kommer att ha ett minimiåtagande på 5 % hållbara investeringar med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att de förbinder sig att anpassa sig till EU-taxonomin.

Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Delfonden har ingen minimiandel socialt hållbara investeringar

Vilka investeringar är inkluderade i ”Nr 2 Annat”, vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

I ”Nr 2 Annat” ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering. Det kan även omfatta värdepapper utan ESG-betyg för vilka uppgifter som behövs för att mäta uppnåendet av miljörelaterade eller sociala egenskaper inte är tillgängliga.

Det finns inga lägsta miljömässiga eller sociala garantier.

Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

Referensvärden är index som mäter om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Denna delfond har inte valt ett specifikt index som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar.

- ***Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Inte tillämpligt

- ***Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?***

Inte tillämpligt

- ***Hur skiljer sig det valda indexet från ett relevant brett marknadsindex?***

Inte tillämpligt

- ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Inte tillämpligt

Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer information om delfonden finns på www.amundietf.com