Informations précontractuelles publiées pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement n'établit pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
AMUNDI INDEX US CORP SRI

Identifiant d'entité juridique :
549300JEQE3CM0S0ZJ51

Caractéristiques environnementales et/ ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

- [ ] **Oui**
- [X] **Non**

- [ ] Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif environnemental : __ %**
  - [ ] dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
  - [ ] dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- [ ] Il réalisera un minimum **d'investissements durables ayant un objectif social : __ %**

- [X] Il **promeut des caractéristiques environnementales et sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il contiendra une proportion minimale de 1 % d'investissements durables.
  - [ ] ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
  - [X] ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
  - [ ] ayant un objectif social
- [ ] Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas d'investissements durables**

Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit.

Quelles caractéristiques environnementales et/ou sociales sont promues par ce produit financier?

Le Compartiment promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales notamment en répliquant un Indice intégrant une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »).

La méthodologie de l'Indice s'appuie sur une « approche best-in-class » : les sociétés les mieux classées sont sélectionnées pour constituer l'Indice.

« Best-in-class » est une approche dans laquelle les investissements les plus performants sont sélectionnés au sein d'un univers, d'un secteur ou d'une catégorie. En utilisant cette approche « Best-in-class », l'Indice suit une approche extra-financière fortement engagée, qui permet de réduire d'au moins 20 % l'univers d'investissement initial (exprimé en nombre d'émetteurs).

Quels sont les indicateurs de durabilité utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des

caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier?

La Notation MSCI ESG est utilisée pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par le produit financier.

La méthodologie de Notation ESG de MSCI utilise une méthodologie fondée sur des règles conçue pour mesurer la résistance d'une entreprise aux risques ESG importants à long terme du secteur. Elle repose sur des questions ESG extra-financières clés qui se concentrent sur l'intersection entre l'activité principale d'une société et les questions spécifiques au secteur qui peuvent créer des risques et des opportunités importants pour la société. Les questions clés ESG sont pondérées en fonction de l'impact et de l'horizon temporel du risque ou de l'opportunité. Les questions clés ESG comprennent notamment le stress hydrique, les émissions de carbone, la gestion de la main-d'œuvre ou l'éthique des affaires.

Des informations supplémentaires sur la Notation MSCI ESG sont disponibles à l'adresse suivante :

https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf

Des informations supplémentaires sur la notation MSCI ESG Controversy sont disponibles à l'adresse suivante :

https://www.msci.com/documents/1296102/14524248/MSCI+ESG+Research+Controversies+Executive+Summary+Methodology+-++July+2020.pdf/b0a2bb88-2360-1728-b70e-2f0a889b6bd4

Plus précisément, l'Indice Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI (l'« Indice ») applique les filtres suivants :

1. Les titres constituant l'Indice doivent avoir une note MSCI ESG d'au moins BBB pour être éligibles à l'inclusion.

2. Les sociétés impliquées dans les secteurs/activités* tels que définis par le filtre d'exclusion standard de Bloomberg MSCI SRI comprenant l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, le divertissement pour adultes, les organismes génétiquement modifiés (OGM), l'énergie nucléaire, les armes conventionnelles et controversées, les armes à feu civiles, le charbon thermique ou les combustibles fossiles sont exclues.

3. Les sociétés dont la note MSCI ESG Impact Monitor (qui mesure l'implication d'un émetteur dans des activités controversées majeures et leur niveau de conformité aux normes et principes internationaux) est « rouge » sont exclues.

Les titres restants sont pondérés en fonction de leur capitalisation boursière totale et réajustés afin de maintenir une allocation sectorielle neutre par rapport à leur Indice cadre. Si après application des filtres ESG, moins de 20 % du nombre total d'émetteurs de l'univers éligible sont exclus, les émetteurs restants sont classés selon les critères suivants :
- notation MSCI ESG (une notation ESG plus élevée est préférable pour rester dans l'indice)
- notation MSCI ESG Controversies (une notation plus élevée en matière de controverses est préférable pour rester dans l'indice)
Ensuite, sur la base de ce classement, les émetteurs seront exclus de l'indice, jusqu'à ce que le nombre d'émetteurs exclus soit supérieur à 20 % du nombre total d'émetteurs de l'univers éligible.

* Pour plus d'informations sur les secteurs/activités et les filtres d'exclusion, veuillez consulter la méthodologie de l'Indice disponible sur bloombergindices.com

Quels sont les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser et comment l'investissement durable contribue-t-il à ces objectifs?

Les objectifs des investissements durables sont d'investir dans des sociétés qui cherchent à répondre à deux critères :

1) suivre les meilleures pratiques environnementales et sociales ; et

2) éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services qui nuisent à l'environnement et à la société.

Pour que la société bénéficiaire des investissements puisse contribuer à l'objectif ci-dessus, elle doit afficher la « meilleure performance » au sein de son secteur d'activité sur au moins un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants.

La définition de « meilleure performance » repose sur la méthodologie ESG exclusive d'Amundi, qui vise à mesurer la performance ESG d'une société bénéficiaire d'investissements. Pour être considérée comme affichant la « meilleure performance », une société bénéficiaire d'investissements doit obtenir les trois meilleures notes (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) au sein de son secteur, sur au moins un facteur environnemental ou social important. Les facteurs environnementaux et sociaux importants sont identifiés au niveau sectoriel. L'identification des facteurs importants s'appuie sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi, qui combine des données extra-financières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme importants contribuent pour plus de 10 % au score ESG global. Pour le secteur de l'énergie, par exemple, les facteurs importants sont les suivants : émissions et énergie, biodiversité et pollution, santé et sécurité, populations locales et droits de l'homme. Pour une présentation plus complète des secteurs et des facteurs, consultez la déclaration sur la réglementation ESG d'Amundi, disponible sur le site www.amundi.lu

Pour contribuer aux objectifs ci-dessus, la société bénéficiaire des investissements ne doit pas être exposée de manière significative à certaines activités (p. ex. le tabac, les armes, les jeux d'argent, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique) non compatibles avec ces critères.

La nature durable d'un investissement est évaluée au niveau de la société bénéficiaire des investissements.

En appliquant la définition de l'investissement durable d'Amundi, qui est décrite ci-dessus, aux composantes de l'Indice de ce produit ETF géré passivement, Amundi a déterminé que ce Produit présente la proportion minimale d'investissements durables indiquée à la page 1 ci-dessus. Toutefois, veuillez noter que la définition de l'investissement durable d'Amundi n'est pas intégrée au niveau de la méthodologie de l'Indice.

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser ne causent-ils pas de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social?

Pour garantir que les investissements durables ne nuisent pas de manière significative (« DNSH »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre de test DNSH s'appuie sur le suivi des indicateurs obligatoires relatifs aux principales incidences négatives, répertoriés dans l'Annexe 1, Tableau 1 du RTS, lorsque des données fiables sont disponibles (par exemple, l'intensité des GES des sociétés bénéficiaires des investissements) par le biais d'une combinaison d'indicateurs (par ex. l'intensité des émissions de carbone) et de seuils ou de règles spécifiques (par exemple, l'intensité carbone de la société émettrice n'appartient pas au dernier décile du secteur).
Amundi prend déjà en considération les principales incidences négatives au sein de sa politique d'exclusion, comme partie intégrante de sa politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

Au-delà des facteurs spécifiques de durabilité couverts dans le premier filtre, Amundi a défini un

deuxième filtre, qui ne tient pas compte des principales incidences négatives ci-dessus, afin de vérifier que la société n'affiche pas de mauvaises performances d'un point de vue environnemental ou social global par rapport à d'autres sociétés de son secteur, ce qui correspond à un score environnemental ou social supérieur ou égal à E en utilisant la notation ESG d'Amundi.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives sur les facteurs de durabilité ont-ils été pris en considération ?

Les indicateurs d'incidence négative ont été pris en compte comme indiqué dans le premier filtre DNSH (do not significant harm, ne pas causer de préjudice important) ci-dessus :

Le premier filtre DNSH s'appuie sur le suivi des indicateurs obligatoires relatifs aux principales incidences négatives, répertoriés dans l'Annexe 1, Tableau 1 du RTS, où des données fiables sont disponibles via la combinaison des indicateurs suivants et des seuils ou règles spécifiques :

Ont une intensité de CO2 qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés de son secteur (s'applique uniquement aux secteurs à forte intensité), et

Présentent une diversité au sein du Conseil d'administration qui n'appartient pas au dernier décile par rapport aux autres sociétés de son secteur, et

Ne sont impliquées dans aucune controverse relative aux conditions de travail et aux droits de l'homme.

Ne sont impliquées dans aucune controverse relative à la biodiversité et à la pollution

Amundi prend déjà en considération les principales incidences négatives au sein de sa politique d'exclusion, comme partie intégrante de sa politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des tests détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : armes controversées, violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, charbon et tabac.

Dans quelle mesure les investissements durables sont-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme? Description détaillée:

Les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés à notre méthodologie de notation ESG. Notre outil exclusif de notation ESG évalue les émetteurs à l'aide des informations communiquées par nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle a un critère dédié appelé « Implication au sein de la communauté et aux droits de l'homme » qui s'applique à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, y compris les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations de travail. En outre, nous effectuons, au minimum tous les trimestres, un suivi des controverses, sur les sociétés identifiées comment étant en violation sur la question des droits de l'homme. En cas de controverses, les analystes évalueront la situation, appliqueront un score à la controverse (à l'aide de notre méthodologie de notation exclusive) et détermineront la meilleure marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour tous les trimestres pour contrôler la tendance et les efforts de correction.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan

environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Ce produit financier prend-il en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité?

X Oui, le Compartiment prend en considération les principales incidences négatives répertoriées dans l'Annexe 1, Tableau 1 du RTS, applique la stratégie du Compartiment et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusion (normatives et sectorielles), d'approches d'engagement et de vote.

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, basées sur l'activité et le secteur couvrant certains des principaux indicateurs défavorables de durabilité énumérés dans le Règlement « Disclosure ».

- Engagement : L'engagement est un processus continu et axé sur un objectif visant à influencer les activités ou le comportement des sociétés bénéficiaires des investissements. L'objectif des activités d'engagement peut être divisé en deux catégories : intervenir auprès d'un émetteur pour améliorer sa façon d'intégrer la dimension environnementale et sociale, et intervenir auprès d'un émetteur pour améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et liées aux droits de l'homme ou sur d'autres questions de durabilité qui sont importantes pour la société et l'économie mondiale.

- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse globale de toutes les questions à long terme susceptibles d'influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour plus d'informations, consultez la politique de vote d'Amundi.

- Suivi des controverses : Amundi a mis au point un système de suivi des controverses qui s'appuie sur trois fournisseurs de données externes pour assurer systématiquement le suivi des controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie d'une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par les analystes ESG, et par l'examen périodique de son évolution. Cette approche s'applique à tous les fonds d'Amundi.

Pour toute indication sur l'utilisation des principales incidences négatives, consultez la déclaration sur la réglementation ESG d'Amundi, disponible sur le site www.amundi.lu

Non

Quelle stratégie d'investissement ce produit financier suit-il?

La **Stratégie d'investissement** guide les décisions d'investissement selon des facteurs tels que les objectifs d'investissement et la tolérance au risque.

Répliquer la performance de l'Indice Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI (l'« Indice »), et minimiser l'écart de suivi entre la valeur liquidative du compartiment et la performance de l'Indice.

L'Indice Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI est un indice obligataire représentatif de l'univers des titres à taux fixe « investment grade » libellés en USD, qui suit les règles de l'Indice Bloomberg US Aggregate Corporate (l'« Indice cadre ») et applique des critères sectoriels et ESG pour la sélection des titres.

Quels sont les éléments contraignants de la stratégie d'investissement utilisés pour sélectionner les investissements afin d'atteindre chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par ce produit financier?

Les pratiques de **bonne gouvernance** concernent des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel et le respect des obligations fiscales.

Il s'agit d'un ETF géré passivement. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'écart de suivi associé.

L'indice Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI (l'« Indice ») applique les filtres suivants :

1. Les titres constituant l'Indice doivent avoir une note MSCI ESG d'au moins BBB pour être éligibles à l'inclusion.

2. Les sociétés impliquées dans les secteurs/activités* tels que définis par le filtre d'exclusion standard de Bloomberg MSCI SRI comprenant l'alcool, le tabac, les jeux d'argent, le divertissement pour adultes, les organismes génétiquement modifiés (OGM), l'énergie nucléaire, les armes conventionnelles et controversées, les armes à feu civiles, le charbon thermique ou les combustibles fossiles sont exclues.

3. Les sociétés dont la note MSCI ESG Impact Monitor (qui mesure l'implication d'un émetteur dans des activités controversées majeures et leur niveau de conformité aux normes et principes internationaux) est « rouge » sont exclues.

Les titres restants sont pondérés en fonction de leur capitalisation boursière totale et réajustés afin de maintenir une allocation sectorielle neutre par rapport à leur Indice cadre. Si après application des filtres ESG, moins de 20 % du nombre total d'émetteurs de l'univers éligible sont exclus, les émetteurs restants sont classés selon les critères suivants :
- notation MSCI ESG (une notation ESG plus élevée est préférable pour rester dans l'indice)
- notation MSCI ESG Controversies (une notation plus élevée en matière de controverses est préférable pour rester dans l'indice)
Ensuite, sur la base de ce classement, les émetteurs seront exclus de l'indice, jusqu'à ce que le nombre d'émetteurs exclus soit supérieur à 20 % du nombre total d'émetteurs de l'univers éligible.

* Pour plus d'informations sur les secteurs/activités et les filtres d'exclusion, veuillez consulter la méthodologie de l'Indice disponible sur bloombergindices.com

La stratégie Produit s'appuie également sur des politiques d'exclusion systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites plus en détail dans la Politique d'investissement responsable d'Amundi.

Quel est le taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement?

Il n'y a aucun taux minimal d'engagement pour réduire la portée des investissements envisagés avant l'application de cette stratégie d'investissement.

Quelle est la politique suivie pour évaluer les pratiques de bonne gouvernance des sociétés bénéficiaires des investissements?

Nous nous appuyons sur la méthodologie de notation ESG d'Amundi. La notation ESG d'Amundi repose sur un cadre d'analyse ESG exclusif, qui tient compte de 38 critères généraux et sectoriels, y compris des critères de gouvernance. Concernant la dimension de la gouvernance, nous évaluons la capacité d'un émetteur à garantir un cadre de gouvernance d'entreprise efficace qui garantit qu'il atteindra ses objectifs à long terme (par exemple, garantir la valeur de l'émetteur sur le long terme). Les sous-critères de gouvernance pris en compte sont : la structure du conseil d'administration, l'audit et le contrôle, la rémunération, les droits des actionnaires, l'éthique, les pratiques fiscales et la stratégie ESG

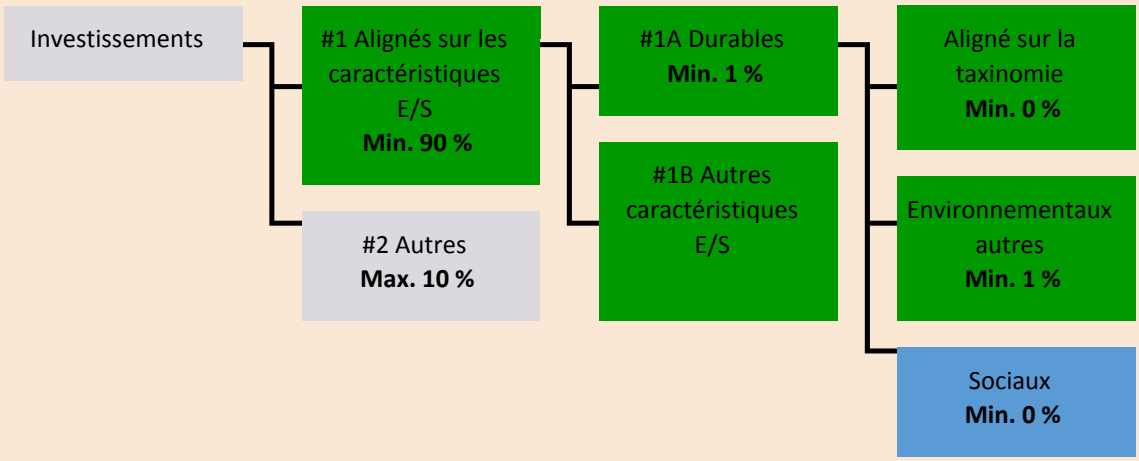
L'échelle de notation ESG d'Amundi comporte sept catégories, allant de A à G, A étant la meilleure note et G la moins bonne. Les sociétés notées G sont exclues de notre univers d'investissement.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Quelle est l'allocation des actifs prévue pour ce produit financier?

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice. En outre, le Compartiment s'engage à disposer d'un minimum de 1 % d'investissements durables, conformément au tableau ci-dessous. Les investissements alignés sur d'autres caractéristiques E/S (#1B) représenteront la différence entre la proportion réelle d'investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales (#1) et la proportion réelle d'investissements durables (#1A).
La proportion prévue d'autres investissements environnementaux représente un minimum de 1 % (i) et peut évoluer à mesure que les proportions réelles d'investissements alignés sur la taxinomie et/ou d'investissements sociaux augmentent.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues parle produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvre les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Comment l'utilisation de produits dérivés atteint-elle les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier?

Les produits dérivés ne sont pas utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Compartiment.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quelle mesure minimale les investissements durables ayant un objectif environnemental sont-ils alignés sur la taxinomie de l'UE?

Le Compartiment n'a pas de part minimale d'investissement ayant un objectif environnemental aligné sur la taxinomie de l'UE.

Le Compartiment ne s'engage actuellement pas à investir un minimum dans des investissements durables ayant un objectif environnemental alignés sur la taxinomie de l'UE, y compris des investissements dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire.

Le produit financier investit-il dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE[1]?

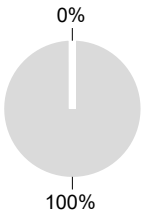
☐ Oui :

☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

X Non

Les deux graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage minimal d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

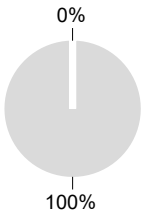
1. Alignement sur la taxinomie des investissements **y compris les obligations souveraines***



■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz fossile et nucléaire)

■ Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement sur la taxinomie des investissements **hors obligations souveraines***



■ Alignés sur la taxinomie (hors gaz fossile et nucléaire)

■ Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100 % des investissements totaux.**

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

** Ce pourcentage est purement indicatif et peut varier.

Quelle est la part minimale d'investissements dans des activités transitoires et habilitantes?

Les fonds n'ont pas de proportion minimale d'investissement dans des activités transitoires ou habilitantes.

1 Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle est la part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la taxinomie de l'UE?

Le Compartiment s'engage à investir minimum de 1 % dans des investissements durables avec un objectif environnemental tel qu'indiqué dans la présente Annexe, sans engagement quant à leur alignement avec la taxinomie de l'UE.

Quelle est la part minimale d'investissements durables sur le plan social?

Le Compartiment n'a pas de part minimale dans des investissements socialement durables.

Quels investissements sont inclus dans la catégorie «#2 Autres», quelle est leur finalité et existe-t-il des garanties environnementales ou sociales minimales?

La section « #2 Autres » comprend les liquidités et les instruments aux fins de gestion des liquidités et du risque de portefeuille. Il peut également inclure des titres non notés ESG pour lesquels les données nécessaires à la mesure de la réalisation des caractéristiques environnementales ou sociales ne sont pas disponibles.

Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si les produits financiers atteignent les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

Un indice spécifique a-t-il été désigné comme indice de référence pour déterminer si ce produit financier est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut?

Oui, l'Indice a été désigné comme indice de référence pour déterminer si le Compartiment est aligné sur les caractéristiques environnementales et/ou sociales qu'il promeut.

- ***Comment l'indice de référence est-il en permanence aligné sur chacune des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier?***

  Conformément à la réglementation applicable aux promoteurs de l'indice (y compris BMR), les promoteurs de l'indice doivent définir des contrôles/vérifications appropriés lors de la définition et/ou de l'exploitation des méthodologies d'indice des indices réglementés.

- ***Comment l'alignement de la stratégie d'investissement sur la méthodologie de l'indice est-il garanti en permanence?***

  L'objectif d'investissement du Compartiment est de refléter à la fois l'évolution à la hausse et à la baisse de l'Indice, tout en minimisant la différence entre le rendement du Compartiment et celui de l'Indice.

- ***En quoi l'indice désigné diffère-t-il d'un indice de marché large pertinent?***

  L'Indice Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI est un indice obligataire représentatif de l'univers des titres à taux fixe « investment grade » libellés en USD, qui suit les règles de l'Indice Bloomberg US Aggregate Corporate (l'« Indice cadre ») et applique des critères sectoriels et ESG pour la sélection des titres.

- ***Où trouver la méthode utilisée pour le calcul de l'indice désigné?***

  Plus d'informations sur l'Indice sont disponibles à l'adresse suivante : https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits.

Où puis-je trouver en ligne davantage d'informations spécifiques au produit?

Plus d'informations sur le Compartiment sont disponibles à l'adresse suivante : www.amundietf.com.

Avertissement

31/07/2023.