



**PROSPECTUS**  
Njukčamánnu 2024

**Amundi Index Solutions**

A Luxembourg UCITS

## INNEHÅLL

|                                                                   |          |
|-------------------------------------------------------------------|----------|
| <b>NÅGRA ORD TILL POTENTIELLA INVESTERARE</b>                     | <b>7</b> |
| <b>BESKRIVNING AV DELFONDERNA</b>                                 | <b>8</b> |
| <b>Delfonderna förvaltas passivt</b>                              | <b>9</b> |
| AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA | 10       |
| AMUNDI INDEX FTSE EPRA NAREIT GLOBAL <sup>(1)</sup>               | 13       |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS                                | 15       |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE                                          | 17       |
| AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB               | 19       |
| AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB                     | 21       |
| AMUNDI INDEX MSCI WORLD                                           | 24       |
| AMUNDI CAC 40 ESG                                                 | 26       |
| AMUNDI DJ SWITZERLAND TITANS 30                                   | 28       |
| AMUNDI DAX                                                        | 30       |
| AMUNDI DIVDAX                                                     | 32       |
| AMUNDI SDAX                                                       | 34       |
| AMUNDI EURO STOXX 50                                              | 36       |
| AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30                               | 38       |
| AMUNDI F.A.Z. 100                                                 | 40       |
| AMUNDI FTSE EPRA EUROPE REAL ESTATE                               | 42       |
| AMUNDI ITALY MIB ESG                                              | 44       |
| AMUNDI GLOBAL INFRASTRUCTURE                                      | 46       |
| AMUNDI JAPAN TOPIX                                                | 48       |
| AMUNDI JPX-NIKKEI 400                                             | 50       |
| AMUNDI MSCI BRAZIL                                                | 52       |
| AMUNDI MSCI CHINA TECH ESG SCREENED                               | 54       |
| AMUNDI MSCI CHINA A II                                            | 56       |
| AMUNDI MSCI EM ASIA                                               | 58       |
| AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA                                      | 60       |
| AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS                                      | 62       |
| AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS                     | 64       |
| AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH                                         | 67       |
| AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH                                         | 69       |
| AMUNDI MSCI EUROPE HIGH DIVIDEND FACTOR                           | 71       |
| AMUNDI MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY FACTOR                      | 73       |
| AMUNDI MSCI EUROPE MOMENTUM FACTOR                                | 76       |
| AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR                                 | 78       |
| AMUNDI MSCI EUROPE VALUE FACTOR                                   | 80       |
| AMUNDI MSCI INDIA                                                 | 82       |
| AMUNDI MSCI NORDIC                                                | 84       |
| AMUNDI MSCI SWITZERLAND                                           | 86       |
| AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS                                   | 88       |
| AMUNDI MSCI USA MINIMUM VOLATILITY FACTOR                         | 90       |
| AMUNDI MSCI WORLD                                                 | 92       |
| AMUNDI MSCI WORLD III                                             | 94       |
| AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED                              | 97       |
| AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE                                       | 99       |
| AMUNDI NASDAQ-100                                                 | 101      |
| AMUNDI NYSE ARCA GOLD BUGS                                        | 103      |
| AMUNDI PEA DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE                           | 105      |
| AMUNDI RUSSELL 2000                                               | 107      |
| AMUNDI S&P 500                                                    | 109      |
| AMUNDI S&P 500 BUYBACK                                            | 111      |
| AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY                                          | 113      |
| AMUNDI SMART CITY                                                 | 115      |

|                                                                |     |
|----------------------------------------------------------------|-----|
| AMUNDI MSCI SMART CITIES ESG SCREENED                          | 117 |
| AMUNDI SMART FACTORY                                           | 119 |
| AMUNDI STOXX EUROPE 600                                        | 121 |
| AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED                         | 123 |
| AMUNDI PRIME EMERGING MARKETS                                  | 126 |
| AMUNDI PRIME EUROPE                                            | 128 |
| AMUNDI PRIME EUROZONE                                          | 130 |
| AMUNDI PRIME GLOBAL                                            | 132 |
| AMUNDI PRIME JAPAN                                             | 134 |
| AMUNDI PRIME UK MID AND SMALL CAP                              | 136 |
| AMUNDI PRIME USA                                               | 138 |
| AMUNDI INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB                              | 140 |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB                     | 143 |
| AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB                                  | 146 |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB                               | 149 |
| AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB                                | 152 |
| AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB                     | 155 |
| AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB                                  | 157 |
| AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB                                | 160 |
| AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB                                     | 163 |
| AMUNDI DAX 50 ESG                                              | 165 |
| AMUNDI MDAX ESG                                                | 167 |
| AMUNDI S&P 500 ESG                                             | 169 |
| AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG                                    | 171 |
| AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT            | 173 |
| AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT                           | 175 |
| AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT               | 177 |
| AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS                               | 179 |
| AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT                             | 182 |
| AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT                             | 184 |
| AMUNDI MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT                           | 187 |
| AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT                         | 190 |
| AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION                       | 196 |
| AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB                       | 199 |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB                         | 202 |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB                       | 204 |
| AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION                      | 207 |
| AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB | 210 |
| AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB          | 213 |
| AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB                    | 216 |
| AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG                                      | 218 |
| AMUNDI GLOBAL AGG SRI                                          | 221 |
| AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5                                      | 224 |
| AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y                                    | 227 |
| AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI                                | 229 |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI                                      | 231 |
| AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y                          | 233 |
| AMUNDI INDEX US CORP SRI                                       | 235 |
| AMUNDI US AGG SRI                                              | 237 |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI                             | 239 |
| AMUNDI MSCI EMU CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB                  | 241 |
| AMUNDI CHINA CNY BONDS <sup>(1)</sup>                          | 243 |
| AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG                             | 245 |
| AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND                                   | 247 |
| AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND <sup>(1)</sup>       | 249 |
| AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG                         | 251 |
| AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND <sup>(1)</sup>                     | 253 |

|                                                                                                                                 |            |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| AMUNDI INDEX J.P. MORGAN GBI GLOBAL GOVIES <sup>(1)</sup>                                                                       | 255        |
| AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG                                                                                                 | 257        |
| AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                                                                             | 259        |
| AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG                                                                                     | 261        |
| AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG                                                                                     | 263        |
| AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                                                                                     | 266        |
| AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOX                                                                                         | 269        |
| AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT <sup>(1)</sup>                                                                       | 271        |
| AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y <sup>(1)</sup>                                                                                 | 273        |
| AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND <sup>(1)</sup>                                                                         | 275        |
| AMUNDI GOVT BOND HIGHEST RATED EURO INVESTMENT GRADE <sup>(1)</sup>                                                             | 277        |
| AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE <sup>(1)</sup>                                                              | 279        |
| AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3 <sup>(1)</sup>                                                          | 281        |
| AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 1-3Y <sup>(1)</sup>                                                                            | 284        |
| AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 10Y <sup>(1)</sup>                                                                             | 286        |
| AMUNDI EUR CORPORATE BOND                                                                                                       | 288        |
| AMUNDI PRIME EURO GOV BONDS 0-1Y                                                                                                | 290        |
| AMUNDI PRIME EURO GOVIES <sup>(1)</sup>                                                                                         | 292        |
| AMUNDI PRIME GLOBAL GOVERNMENT BOND <sup>(1)</sup>                                                                              | 294        |
| AMUNDI PRIME US CORPORATES                                                                                                      | 296        |
| AMUNDI PRIME US TREASURY <sup>(1)</sup>                                                                                         | 298        |
| AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y                                                                                                    | 300        |
| AMUNDI SHORTEX DAILY (-1X) INVERSE                                                                                              | 302        |
| AMUNDI GERMAN BUND DAILY (-1X) INVERSE <sup>(1)</sup>                                                                           | 305        |
| AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG                                                                                                      | 308        |
| AMUNDI FTSE EPRA NAREIT GLOBAL DEVELOPED                                                                                        | 310        |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG                                                                                              | 312        |
| AMUNDI MSCI EMU SMALL CAP ESG CTB NET ZERO AMBITION                                                                             | 314        |
| AMUNDI STOXX EUROPE SELECT DIVIDEND 30                                                                                          | 316        |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION                                                                                 | 318        |
| AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                                                                                        | 321        |
| AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                                                                                        | 324        |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2027 ITALY BTP GOVERNMENT BOND                                                                            | 327        |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2027 GERMAN BUND GOVERNMENT BOND                                                                          | 329        |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND BROAD                                                                           | 331        |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND YIELD +                                                                         | 333        |
| AMUNDI MSCI EM ASIA ESG CTB NET ZERO AMBITION                                                                                   | 335        |
| AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1-5Y HIGHEST RATED                                                                                  | 337        |
| <b>NOTERINGAR OM DELFONDSKOSTNADER</b>                                                                                          | <b>339</b> |
| <b>RISKBESKRIVNINGAR</b>                                                                                                        | <b>343</b> |
| RISKER VID NORMALA MARKNADSFÖRHÅLLANDEN                                                                                         | 343        |
| RISKER VID OVANLIGA MARKNADSFÖRHÅLLANDEN                                                                                        | 349        |
| <b>ALLMÄN PLACERINGSINRIKTNING</b>                                                                                              | <b>350</b> |
| TILLÄTNA VÄRDEPAPPER OCH TRANSAKTIONER                                                                                          | 350        |
| <b>KRAV PÅ DIVERSIFIERING</b>                                                                                                   | 352        |
| <b>FONDER SOM FÖLJER INDEX</b>                                                                                                  | 353        |
| BEGRÄNSNINGAR FÖR ATT FÖRHINDRA BETYDANDE INFLYTANDE                                                                            | 353        |
| FEEDERFONDER                                                                                                                    | 354        |
| HANTERING OCH ÖVERVAKNING AV GLOBAL RISKEXPONERING                                                                              | 354        |
| Replikeringsmetoder för passivt förvaltat delfond                                                                               | 355        |
| <b>MER OM DERIVAT OCH TEKNIKER</b>                                                                                              | <b>358</b> |
| TYPEN AV DERIVAT SOM DELFONDERNA FÅR ANVÄNDA                                                                                    | 358        |
| SYFTE MED DERIVATANVÄNDNING                                                                                                     | 358        |
| TEKNIKER OCH INSTRUMENT FÖR TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING                                                          | 359        |
| HANTERING AV SÄKERHETER FÖR OTC-DERIVATTRANSAKTIONER OCH TEKNIKER OCH INSTRUMENT FÖR TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING | 359        |



|                                                                                                       |            |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| SAMMANFATTNING AV PROCESSEN FÖR VAL AV MELLANHÄNDER                                                   | 360        |
| ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR                  | 361        |
| <b>REGELVERK FÖR JÄMFÖRELSEINDEX</b>                                                                  | <b>364</b> |
| <b>INVESTERA I DELFONDERNA</b>                                                                        | <b>367</b> |
| <b>Andelsklasser</b>                                                                                  | <b>367</b> |
| BASBETECKNINGAR FÖR ANDELSKLASSER                                                                     | 367        |
| SUFFIX FÖR ANDELSKLASSER                                                                              | 368        |
| TILLGÄNGLIGA KLASSER                                                                                  | 368        |
| <b>Policyer för andelsklasser</b>                                                                     | <b>369</b> |
| UTFÄRDANDE OCH ÄGARSKAP                                                                               | 369        |
| POLICY FÖR UTDELNING                                                                                  | 369        |
| ANDRA POLICYER                                                                                        | 369        |
| <b>Förvärv, byte, inlösen och överlåtelse av aktier</b>                                               | <b>370</b> |
| PÅ PRIMÄRMARKNADEN                                                                                    | 370        |
| INFORMATION SOM GÄLLER FÖR ALLA TRANSAKTIONER UTOM ÖVERLÅTELSE OCH TRANSAKTIONER PÅ SEKUNDÄRMARKNADEN | 370        |
| FÖRVÄRV AV AKTIER                                                                                     | 370        |
| BYTE AV AKTIER                                                                                        | 371        |
| INLÖSEN AV AKTIER                                                                                     | 371        |
| ÖVERLÅTELSE AV AKTIER                                                                                 | 371        |
| SEKUNDÄRMARKNAD FÖR UCITS ETF-ANDELSKLASSER                                                           | 372        |
| <b>Hur vi beräknar substansvärde</b>                                                                  | <b>373</b> |
| <b>Skatter</b>                                                                                        | <b>374</b> |
| <b>Rättigheter vi förbehåller oss</b>                                                                 | <b>375</b> |
| <b>Kampen mot penningtvätt och finansiering av terrorism</b>                                          | <b>376</b> |
| <b>Sekretess gällande personuppgifter</b>                                                             | <b>377</b> |
| <b>Information för investerare i vissa länder</b>                                                     | <b>377</b> |
| <b>SICAV-fonden</b>                                                                                   | <b>378</b> |
| <b>Tjänsteleverantörer som anlitas av SICAV-fonden</b>                                                | <b>380</b> |
| <b>FÖRVALTNINGSBOLAGET</b>                                                                            | <b>384</b> |
| <b>Bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar</b>                                                         | <b>386</b> |
| AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5                                                                             | 387        |
| AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                                                   | 398        |
| AMUNDI MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT                                                                  | 407        |
| AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT                                                                    | 418        |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB                                                              | 428        |
| AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG                                                           | 439        |
| AMUNDI DAX 50 ESG                                                                                     | 450        |
| AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG                                                                       | 461        |
| AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB                                        | 473        |
| AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION                                                              | 485        |
| AMUNDI US AGG SRI                                                                                     | 496        |
| AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB                                                 | 506        |
| AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT                                                      | 518        |
| AMUNDI MDAX ESG                                                                                       | 529        |
| AMUNDI INDEX US CORP SRI                                                                              | 539        |
| AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT                                                                | 550        |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB                                                                | 561        |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI                                                                    | 572        |
| AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT                                                                  | 582        |
| AMUNDI CAC 40 ESG                                                                                     | 593        |
| AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT                                                                    | 603        |

|                                                     |      |
|-----------------------------------------------------|------|
| AMUNDI GLOBAL AGG SRI                               | 613  |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB                    | 624  |
| AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB                       | 636  |
| AMUNDI MSCI EMU CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB       | 648  |
| AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB                     | 658  |
| AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB         | 670  |
| AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB          | 682  |
| AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT | 694  |
| AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB | 706  |
| AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB                       | 718  |
| AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB                     | 729  |
| AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y               | 741  |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB          | 752  |
| AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB       | 764  |
| AMUNDI INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB                   | 776  |
| AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS                    | 788  |
| AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG                           | 798  |
| AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS       | 808  |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI                           | 820  |
| AMUNDI S&P 500 ESG                                  | 831  |
| AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y                         | 840  |
| Amundi Stoxx Europe 600 ESG                         | 850  |
| AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND            | 859  |
| AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI                     | 867  |
| AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB            | 878  |
| AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB                          | 890  |
| AMUNDI ITALY MIB ESG                                | 902  |
| AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG         | 912  |
| AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG                  | 923  |
| AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION           | 933  |
| AMUNDI MSCI EMU SMALL CAP ESG CTB NET ZERO AMBITION | 943  |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION     | 953  |
| AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG            | 963  |
| AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG            | 972  |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG                  | 981  |
| AMUNDI MSCI CHINA TECH ESG SCREENED                 | 991  |
| AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED                | 1001 |
| AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED              | 1010 |
| AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS                     | 1020 |
| AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG         | 1029 |
| AMUNDI MSCI SMART CITIES ESG SCREENED               | 1039 |
| Amundi MSCI EM Asia ESG CTB Net Zero Ambition       | 1049 |
| AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1-5Y HIGHEST RATED      | 1058 |

# 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 banksättningar. 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 aktieäggande 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.

**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.

**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).

**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.

**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** innebär 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 minimigärantier 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.

**Institutionella investerare** Investerare som kvalificerar sig som institutionella investerare enligt artikel 175 i 2010 års lag och enligt CSSF:s riktlinjer eller rekommendationer.

**Kreditvärdighet** Klassificerad med minst BBB- av S&P, Baa3 av Moody's och/eller BBB- (av Fitch).

**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.

**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)

# 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:

- maximala avgifter för köp, byte och inlösen av aktier: detta avsnitt (huvudklasser) och avsnittet "Investera i delfonderna" (alla grupper av klasser).
- maximala årsavgifter som dras av 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.

**MENA** (Middle East and North Africa (Mellanöstern och Nordafrika)) Bahrain, Egypten, Jordanien, Kuwait, Libanon, Marocko, Oman, Qatar, Saudiarabien, Tunisien och Förenade Arabemiraten.

**Substansvärde** Värdet på en andel.

**Prospekt** Detta dokument, med ändringar från tid till annan.

**Tekniska standarder för tillsyn** är en konsoliderad uppsättning tekniska standarder som definierades av Europaparlamentet och rådet och offentliggjordes den 06 april 2022, som ger ytterligare information om innehållet, metoden och presentationen av vissa befintliga upplysningskrav enligt förordningen om hållbarhetsupplysningar och taxonomiförordningen. Tekniska standarder för tillsyn åtföljdes av fem bilagor, som innehåller mallar för obligatoriska upplysningar.

**SICAV-fonden** Amundi Index Solutions, en SICAV-fond med säte i Luxemburg.

**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.

**Taxonomiförordningen** innebär 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").

**Transaktionsdag** En bankdag då mottagna och godkända begäran om teckning, inlösen eller konvertering kan behandlas av registratören 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](http://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 bofast i USA, en stiftelse som har en person boende i USA som förvaltare, eller en egendom som en person boende i USA är exekutor för eller administratör av
- ett partnerskap eller företag som regleras enligt amerikansk federal eller statlig 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 stiftelsekonto) som innehas av en återförsäljare eller annan förvaltare som är någon av ovanstående, eller till förmån för eller konto hos någon av ovanstående eller nedanstående
- ett partnerskap eller bolag som är organiserat eller registrerat 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 är organiserat och ägt 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 bofast i USA, eller en sådan persons egendom
- ett partnerskap eller bolag som regleras i USA eller enligt amerikansk federal eller statlig 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.

**Valutaförkortningar**

**AUD** australisk dollar

**CAD** kanadensisk dollar

**CHF** schweizisk franc

**CZK** tjeckisk koruna

**DKK** dansk krone

**EUR** euro

**GBP** brittiskt pund

**HDK** Hongkongdollar

**HUF** ungersk forint

**JPY** japansk yen

**MXN** mexikansk peso

**NOK** norsk krone

**NZD** nyzeeländsk dollar

**PLN** polsk zloty

**RMB** kinesisk renminbi

**RON** rumänsk leu

**SEK** svensk krona

**SGD** singaporiensk dollar

**THB** thailändsk baht

**USD** US-dollar

Delfonderna förvaltas passivt

# AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC Index är ett aktieindex som består av aktier i medelstora och stora företag i industriländer. Målet är att generera högre avkastning än aktier i stora och medelstora företag på utvecklade marknader (globalt område) viktat efter börsvärdet. Indexet tillämpar flera säkerhetsfilter för värdepappersval för detta globala område och flera viktningssystem för att erhålla en sammansättning som syftar till att uppnå detta mål.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Global Universe består av aktier i stora och medelstora företag. För att optimera likviditeten i Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC Index, är de värdepapper som valts ut inom detta globala område de i företag i länder som:

- nyligen har haft högst volym och frekvens i handel och
  - har störst fritt omsättningsbart börsvärde jämfört med alla aktier i det underliggande investeringsområdet.
- Aktierna i de företag som används utgörs därför av jämförelseområdet vilket omfattar cirka 2000 aktier (nedan kallade "de 2000 aktierna").

Fyra filter för säkert urval tillämpas på jämförelseområdet för att skapa underindex:

- värderingskriterium: från de 2000 aktierna i jämförelseområdet väljs 50 % av dem med de lägsta marknadsvärderingarna, dvs de med den högsta värderingsgraden (företagets bokförda värde dividerat med dess marknadsvärde)
- storlekskriterium: från de 2000 aktierna i jämförelseområdet väljs 50 % av dem med det minsta börsvärdet
- momentumkriterium: från de 2000 aktierna i jämförelseområdet väljs 50 % av dem med den högsta avkastningen under de 12 månader som föregår urvalet (den avkastning som beaktas är lika med aktiens resultat med återinvesterade utdelningar)
- volatilitetskriterium: från de 2000 aktierna i jämförelseområdet väljs 50 % av dem med lägst volatilitet under de 12 månader som föregår urvalet

Vart och ett av dessa fyra urval om cirka 1000 värdepapper utgör ett delindex.

Fem viktningmetoder tillämpas på de aktier som utgör vart och ett av dessa fyra delindex:

- maximal decentralisering: strategi som består i att tilldela en identisk viktning till varje beståndsdel (lika viktning)
- maximal dekorrelation: strategi som består i att tilldela en viktning till varje beståndsdel som beräknas på grundval av en korrelationsmatris. bidrar till målet om att minimera portföljens förväntade volatilitet under förutsättning att den enskilda volatiliteten i värdepappret är identisk
- riskspridning ("viktad diversifierad risk"): strategi som består i att tilldela varje beståndsdel en viktning som gör det möjligt för den att bidra lika mycket till den totala risken för delindexet mätt på dess historiska volatilitet under de 12 månader som föregår urvalet
- minsta volatilitet ("effektiv minsta volatilitet"): strategi som består i att tilldela varje beståndsdel en viktning beräknad på grundval av historisk volatilitet och dess korrelation med de andra komponenterna under de 12 månader som föregår valet för att minimera portföljens förväntade volatilitet
- Maximering av Sharpe-kvoten ("effektiv maximal Sharpe-kvot"): strategi som består av att tilldela varje komponent en viktning baserat på dess bidrag till den förväntade Sharpe-kvoten. De komponenter som bidrar mest till förväntad Sharpe-kvot viktas relativt högre än de som bidrar minst till detta mål. Sharpe-kvoten mäter avkastningen jämfört med den risk som tas, med risk som mäts med volatiliteten under de 12 månader som föregår valet.

Viktningen av värdepapper i vart och ett av de fyra delindexen erhålls genom att för varje värdepapper ta den genomsnittliga vikt som erhålls med hjälp av de fem viktningmetoder som beskrivs ovan.

Dessa fyra delindex som används för att sammanställa Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC Index, viktas sedan i enlighet med metoden "lika riskbidrag". Detta innebär att varje delindex måste bidra lika till den relativa risk som mäts med hjälp av den aktiva risken jämfört med jämförelseindexets område som viktas enligt börsvärde.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av ERI Scientific Beta ("SciBeta").

SciBeta officiella index beräknas av SciBeta utifrån:

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

Värdet på Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SBDXRHMN

Resultatet som följs är stängningskursen för Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i SciBeta-indexet finns på [scientificbeta.com](http://scientificbeta.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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Valuta           | Marknad                               |
| Derivat          | Aktier i små och medelstora företag   |
| Aktieexponering  | Stil                                  |
| Indexreplikering | Hållbarhet                            |
| Investeringsfond | Användning av tekniker och instrument |
| Förvaltning      |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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
- är intresserade av investeringstillväxt på lång sikt samtidigt som de diversifierar en portfölj genom att lägga till exponering mot "Smart Beta"-aktier i utvecklade länder

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

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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

| Andelsklass        | Valuta | Minsta initiala investering* | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|--------------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
|                    |        |                              | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| AE                 | EUR    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,36 %            | 0,14 %               |
| IE                 | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,11 %            | 0,14 %               |
| UCITS ETF DR – EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,30 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR – USD | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC ("STRATEGINS INDEX") SOM DET HÄNVISAS TILL HÄR TILLHÖR EDHEC RISK INSTITUTE ASIA LTD ("ERIA") OCH HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I ANSLUTNING TILL AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA INOM RAMEN FÖR ERI SCIENTIFIC BETA ACTIVITY. STRATEGINS INDEX BERÄKNAS AV ERI SCIENTIFIC BETA PÅ GRUNDVAL AV EDHEC-RISK INSTITUTE-METODEN.

VARJE PART ERKÄNNER OCH SAMTYCKER TILL ATT AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA INTE SPONSRAS ELLER STÖDS AV ERIA. ERIA 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 ANVÄNDNINGSMÖRÅDE) BETRÄFFANDE STRATEGINS INDEX OCH ALLA DÄRI INGÅENDE ELLER RELATERADE DATA, OCH FRISKRIVER SIG SÄRSKILT FRÅN ALLA GARANTIER BETRÄFFANDE KVALITET, RIKTIGHET OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHET RÖRANDE STRATEGINS INDEX ELLER DÄRI INGÅENDE DATA, DE RESULTAT SOM ERHÅLLS TILL FÖLJD AV ANVÄNDNING AV STRATEGINS INDEX OCH/ELLER SAMMANSÄTTNINGEN AV STRATEGINS INDEX 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 STRATEGINS INDEX VID NÅGON VISS TIDPUNKT PÅ NÅGOT VISST DATUM ELLER ANNARS. ERIA SKA INTE HÅLLAS ANSVARIG (VARE SIG PÅ GRUND AV OAKTSAMHET ELLER ANNAT) GENTEMOT PARTERNA ELLER NÅGON ANNAN PERSON FÖR EVENTUELLA FEL I STRATEGINS INDEX OCH HAR INGEN SKYLDIGHET ATT MEDDELA PARTERNA ELLER NÅGON PERSON OM FEL DÄRI. ERIA GÖR INGA SOM HELST UTFÄSTELSER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT KÖPA ELLER SÄLJA AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA, OM FÖRMÅGAN FÖR STRATEGINS INDEX ATT FÖLJA RELEVANTA MARKNADSRESULTAT, ELLER SOM PÅ ANNAT SÄTT ÄR RELATERADE TILL STRATEGINS INDEX ELLER TRANSAKTIONER ELLER PRODUKTER MED KOPPLING DÄRTILL. ERIA HAR INGEN SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL NÅGON PARTS BEHOV NÄR STRATEGINS INDEX FASTSTÄLLS, SAMMANSTÄLLS ELLER BERÄKNAS. INGEN PART SOM KÖPER ELLER SÄLJER AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA HAR, I LIKHET MED ERIA, NÅGOT ANSVAR GENTEMOT NÅGON PART FÖR ERIAS HANDLINGAR ELLER UNDERLÅTENHET ATT HANDLA I SAMBAND MED FASTSTÄLLANDE, JUSTERING, BERÄKNING ELLER UPPRÄTTHÅLLANDE AV STRATEGINS INDEX.

## 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

FTSE EPRA/NAREIT Developed Index 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
- Indexsammansättning

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).

Värdet för FTSE EPRA/NAREIT Developed Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: TRNGLE

Det resultat som följs är stängningskursen för FTSE EPRA/NAREIT Developed Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](http://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.

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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| AE           | EUR    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 0,19 %               |
| IE           | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,14 %               |
| UCITS ETF DR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 % <sup>*</sup>              | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX FTSE EPRA NAREIT GLOBAL 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 UTFÅSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE EPRA/NAREIT DEVELOPED INDEX ("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 DÄR. "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 INDEX 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

MSCI Emerging Markets Index 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
- Indexsammansättning

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).

Värdet för MSCI Emerging Markets Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGF

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Emerging Markets Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 2 %. 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 innehå 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Valuta                                           | Investeringsfond                      |
| Derivat                                          | Förvaltning                           |
| Tillväxtmarknader                                | Marknad                               |
| Aktieexponering                                  | Hållbarhet                            |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| AE                 | EUR    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,30 %            | 0,15 %               |
| IE                 | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR       | EUR    | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄR 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FASTSTÄLLANDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖR LÖRDAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX 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

MSCI Europe Index 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
- Indexsammansättning

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).

Värdet för MSCI Europe Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M7EU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,05 %               |
| UCITS ETF DR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 % <sup>*</sup>              | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ("DELFONDEN") SPONSAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄ I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERÄ I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÄGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÄ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSIVÄRE 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 NÄGON 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 INGÄ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÄN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÄLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÄGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÄGOT MSCI-INDEX ELLER NÄGRA DATA SOM INGÄR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÄGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÄGOT MSCI-INDEX ELLER NÄGRA DATA SOM INGÄR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÄGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÄGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER SIG HÄRMEU UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÄL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÄR I DEM. UTAN ATT DETTA PÄVERKAR NÄGOT AV DET OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÄGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÄGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPEU FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÄDANA SKADOR.



# AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB

## 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

MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI JAPAN Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapper för stora och medelstora bolag på den japanska marknaden. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. 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.

- Indexvaluta: Japansk yen

- Indexsammansättning

MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka MSCI 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, 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).

Värdet för MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXJPEGL

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Japan ESG Broad CTB Select 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 innehålla 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 investeringskattelagen:** 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 på högst 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 innehålla positioner 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:** Japansk yen

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,05 %               |
| UCITS ETF EUR          | 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 %               |

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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB ("Delfonden") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 ÄGARNÄ 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FASTSTÄLLANDE 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB

## 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

MSCI North America ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI North America Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepappren för stora och medelstora bolag på den amerikanska och kanadensiska marknaden. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI North America ESG Broad CTB Select Index 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, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI North America ESG Broad CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXNAEBSL

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI North America ESG Broad CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "*Riskbeskrivningar*" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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          | USD    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 0,15 %               |
| IE          | EUR    | 500 000 USD                  | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

MSCI World Index 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
- Indexsammansättning

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).

Värdet för MSCI World Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDDUWI

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI World Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

|             |        |                              | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|-------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
| Andelsklass | Valuta | Minsta initiala investering* | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |

\*från 2 maj 2018

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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI WORLD ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UTFÅSTELSER 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 FRÄNSÄGER 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.



## 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

CAC 40 ESG Index är ett aktieindex som motsvarar de 40 största bolagen i CAC Large 60 Index, som motsvarar de 60 ledande aktierna på Parisbörsen ("överordnat index"), som har visat kraftfull miljöpraxis, social praxis och bolagsstyrningspraxis. Indexets syfte är att ge ett minskat viktat koldioxidavtryck och bättre grönt/brunt-förhållande jämfört med det överordnade indexet.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 Euronext.

CAC 40 Index beräknas av Euronext med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där de värdepapper som ingår i indexet handlas.

Värdet för CAC 40 ESG Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: CACESGMR

Det resultat som följs är stängningskursen för CAC 40 ESG Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Euronext-indexet finns på 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 innehålla 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".

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**Den tyska investeringsskattelagen:** Minst 65 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börse 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 på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursställning.

### 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 innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Indexreplikering | Marknad                               |
| Investeringsfond | Hållbara investeringar                |
| Förvaltning      | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 16:00 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:**

**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 | 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](https://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 innehar alla (immateriella) besittningsrättigheter med avseende på indexet. 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 fransäger 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.

CAC® och CAC 40® är registrerade varumärken som tillhör Euronext N.V. och dess dotterbolag.

## 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

Dow Jones Switzerland Titans 30 Total Return Index 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
- Indexsammansättning

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").

Värdet för Dow Jones Switzerland Titans 30 Total Return Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: DJCH30TR

Det resultat som följs är stängningskursen för Dow Jones Switzerland Titans 30 Total Return Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på 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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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:** CHF

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Valuta                                           | Förvaltning                           |
| Derivat                                          | Marknad                               |
| Aktieexponering                                  | Volatilitet                           |
| 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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   | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI DJ SWITZERLAND TITANS 30 SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG ("S&P"). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA, TILL ÄGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÅRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS S&P 500 INDEX 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 S&P 500, 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 S&P 500 INDEX 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 S&P 500 INDEX 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 UNDERFÖRSTÄDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV S&P 500-INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV S&P 500 ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

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

DAX Index 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 totalavkastningsindex: utdelningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

DAX-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 DAX Index 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 .

Värdet för DAX INDEX är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: DAX

Det resultat som följs är stängningskursen för DAX INDEX.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stxx.com](http://stxx.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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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 totalavkastningssvappar 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

|                                                                          |                                       |
|--------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader |                                       |
| Derivat                                                                  | Marknad                               |
| Aktieexponering                                                          | 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,03 %            | 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](http://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 DAX INDEX® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI DAX.

STOXX och dess licensgivare:

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

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI DAX. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
  - De resultat som kan erhållas av AMUNDI DAX, ägare av AMUNDI DAX eller andra personer i samband med användningen av DAX INDEX och data i DAX INDEX®.
  - Att DAX INDEX och dess data är korrekta eller fullständiga.
  - Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av DAX INDEX® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i DAX INDEX® 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 AMUNDI DAX eller andra tredje parter.

## 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

DivDAX Total Return Index är ett aktieindex som representerar 15 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 totalavkastningsindex: utdelningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Indexet omfattar de 15 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 .

Värdet för DivDAX Total Return Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: DIVDAX

Det resultat som följs är stängningskursen för DivDAX Total Return Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stoxx.com](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Derivat          | Marknad                               |
| Aktieexponering  | 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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](http://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 DivDAX Total Return Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI DIVDAX.

STOXX och dess licensgivare:

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

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI DIVDAX. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
  - De resultat som kan erhållas av AMUNDI DIVDAX, ägarna av AMUNDI DIVDAX eller andra personer i samband med användningen av DivDAX Total Return Index och data i DivDAX Total Return Index®.
  - Att DivDAX Total Return Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
  - Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av DivDAX Total Return Index® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för fel, utelämnanden eller avbrott i DivDAX Total Return Index® 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 AMUNDI DIVDAX eller andra tredje parter.

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

SDAX Total Return Index 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: Euro
- Indexsammansättning

SDAX Index 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 SDAX 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 .

Värdet för SDAX Total Return Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SDYP

Det resultat som följs är stängningskursen för SDAX Total Return Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stoxx.com](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Derivat                                          | Marknad                               |
| Aktieexponering                                  | Aktier i små och medelstora företag   |
| Indexreplikering                                 | Volatilitet                           |
| Investeringsfond                                 | Hållbarhet                            |
| 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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](http://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 SDAX Total Return Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI SDAX.

STOXX och dess licensgivare:

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

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI SDAX. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
  - De resultat som kan erhållas av AMUNDI SDAX, ägarna av AMUNDI SDAX eller andra personer i samband med användningen av SDAX Total Return Index och data som inkluderas i SDAX Total Return Index®.
  - Att SDAX Total Return Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
  - Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av SDAX Total Return Index® och dess data.
  - STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för fel, utelämnanden eller avbrott i SDAX Total Return Index® 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 AMUNDI SDAX eller andra tredje parter.

## 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

EURO STOXX® 50 Index 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: Euro

- Indexsammansättning

EURO STOXX 50 Index är ett aktieindex som är representativt för de 50 ledande aktierna i industriländer som också är medlemmar i euroområdet (enligt definitionen i indexmetoden).

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.

EURO STOXX 50 Index beräknas dagligen med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet på EURO STOXX 50 Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SX5T

Det resultat som följs är stängningskursen för EURO STOXX 50 Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stoxx.com](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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.

### 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 på högst 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 innehålla positioner 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 16:00 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 – DAILY HEDGED USD | USD    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %      | 0,05 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR – EUR              | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 3,00 %                      | 1,00 1,00 % | 0,03 % 0,05 %     | 0,04 % 0,10 %        |
| UCITS ETF DR – USD              | USD    | 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](http://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 EURO STOXX 50 Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI EURO STOXX 50.

STOXX och dess licensgivare:

- sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte AMUNDI EURO STOXX 50.
- rekommenderar inte att någon ska investera i AMUNDI EURO STOXX 50 eller andra värdepapper.
- har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av AMUNDI EURO STOXX 50.
- har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av AMUNDI EURO STOXX 50.
- beaktar inte behovet hos AMUNDI EURO STOXX 50 eller ägarna av AMUNDI EURO STOXX 50 när EURO STOXX 50 Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI EURO STOXX 50. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
- De resultat som kan erhållas av AMUNDI EURO STOXX 50, ägaren av AMUNDI EURO STOXX 50 eller andra personer i samband med användningen av EURO STOXX 50 Index och data i EURO STOXX 50®.
- Att EURO STOXX 50 och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av EURO STOXX 50® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för fel, utelämnanden eller avbrott i EURO STOXX 50® 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 AMUNDI EURO STOXX 50 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

EURO STOXX Select Dividend 30 Net Return EUR Index är ett aktieindex som representerar de aktier som ger högst avkastning i förhållande till sin hemmamarknad i läder i euroområdet.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 .

Värdet för EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SD3T

Det resultat som följs är stängningskursen för EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stoxx.com](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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 totalavkastningssvappar 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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](http://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 EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30.

STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30 eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30.
- Beaktar inte behovet hos AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30 eller ägarna av AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30 när EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
  - De resultat som kan erhållas av AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30, ägare av AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30 eller andra personer i samband med användningen av EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index och data i EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index®.
  - Att EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
  - Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index® och dess data.
  - STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för fel, utelämnanden eller avbrott i EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index® 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 AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30 eller andra tredje parter.



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

FAZ Index 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: Euro
- Indexsammansättning

FAZ-indexet består av aktier i de 100 största företagen, som representerar 12 sektorer, har huvudkontor i Tyskland och är noterade på Frankfurtbörsen. Indexet viktas på basis av börsvärde, med en övre viktningsgräns på 10 % i förhållande till varje aktie på varje justeringsdag.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske årsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Värdet för F.A.Z Index finns 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 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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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 totalavkastningssvappar 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Derivat          | Marknad                               |
| Aktieexponering  | 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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](https://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.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

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

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe Index 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).

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
- Indexsammansättning

FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe Strategy Index 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.

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

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av FTSE ("FTSE").

FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe strategy index beräknas dagligen med hjälp av:

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

- WM Reuters valutakurser vid stängning (16.00 GMT)

Värdet för FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NEPRA

Det resultat som följs är stängningskursen för FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](http://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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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 %     | 0,20 %            | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI FTSE EPRA EUROPE REAL ESTATE SUB-FUND 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 FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe INDEX ("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 DÄR. "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.

## 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

MIB ESG Index är ett aktieindex som representerar de 40 främsta företagen som uppvisar stark praxis för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning bland de 60 mest likvida italienska företagen som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet består av alla de företag som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV, 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.

FTSE MIB Index beräknas av FTSE med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet för MIB ESG Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MIBESGNI

Det resultat som följs är stängningskursen för MIB ESG Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Euronext-indexet finns på [euronext.com](http://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 innehålla 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".

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Derivat          | Förvaltning                           |
| Aktieexponering  | Marknad                               |
| Indexreplikering | Hållbara investeringar                |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 %               |

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](https://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 fransäger 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>.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Solactive Global Infrastructure Low Earnings Volatility Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Solactive Global Infrastructure Low Earnings Volatility Index är ett aktieindex som är representativt för börsnoterade infrastrukturbolag över hela världen med den mest stabila resultattillväxten.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Inkludering i indexet baseras på följande kriterier

- noterat eget kapital
- inga handelsrestriktioner för utlåningar
- minsta genomsnittligt handlat dagligt värde på 5 miljoner euro under sex månader
- minsta fritt omsättningsbart börsvärde på 500 miljoner euro
- klassificerat som ett infrastrukturbolag enligt FactSet Revere Business and Industry Classification System (RBICS).

Inom indexets område väljs de 100 aktier som har lägst vinstvolatilitet ut som indexkomponenter.

Solactives metod och beräkningsmetoder innebär att antalet aktier som utgör Solactive Global Infrastructure Low Earnings Volatility Index kan variera men högst vara 100 aktier.

Alla aktier i indexet viktas i förhållande till storleken på dess börsvärde, justerat för det som är fritt omsättningsbart, med en maximal viktgräns på 4 % för varje enskild akte och en maximal sektorexponering på 25 %.

- Indexrevision

Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Solactives 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).

Värdet på Solactive Global Infrastructure Low Earnings Volatility Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLGILEV

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive Global Infrastructure Low Earnings Volatility Index.

Det resultat som följs av indexet är stängningskursen för Solactive Global Infrastructure Low Earnings Volatility Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://solactive.de)

## 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF   | EUR    | 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](http://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 NÄMND A FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

## 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

TOPIX Index 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: Japansk yen
- Indexsammansättning

TOPIX Index omfattar alla japanska aktier som är noterade i "Section One" på Tokyo Stock Exchange och viktat 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 [jpx.co.jp](http://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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 "Replikeringmetoder för index och UCITS ETF-delfonder" i detta prospekt.

De största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF - DAILY HEDGED CHF | CHF    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,38 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR | EUR    | 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 USD | USD    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,38 %            | 0,10 %               |
| 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 %               |

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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

FONDERNA ÄR INTE SPONSRADE, GODKÄNDA, DISTRIBUTERADE ELLER MARKNADSFÖRDA AV TOKYO STOCK EXCHANGE, INC (INDEXLEVERANTÖRER). Indexleverantörerna uttalar sig inte om huruvida en investering är lämplig. En fullständig beskrivning av indexen finns tillgänglig hos Tokyo Stock Exchange, Inc (/leverantörerna).

## 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

JPX-Nikkei 400 Index 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: Japansk yen
- Indexsammansättning

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.

JPX-Nikkei 400 Index beräknas av JPX-gruppen och Nikkei med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas. Värdet för JPX-Nikkei 400 Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: JPNKNTR

Det resultat som följs är stängningskursen för JPX-Nikkei 400 Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Nikkei-indexet finns på [jpx.co.jp](http://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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| 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 %               |
| UCITS ETF - DAILY HEDGED GBP | GBP    | 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 – 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 %               |

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](https://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 AMUNDI JPX-NIKKEI 400. JPX Group och Nikkei har, förutom att licensiera till Amundi Asset Management användningen av vissa varumärken och användningen av indexet för AMUNDI JPX-NIKKEI 400, ingen koppling till AMUNDI JPX-NIKKEI 400. Licensavtalet mellan Amundi Asset Management och både JPX Group och Nikkei ger inga rättigheter till någon tredje part.

Amundi Asset Management 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 AMUNDI JPX-NIKKEI 400. 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.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

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

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

MSCI Brazil Index är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas i Brasilien.

Indexet är ett nettoavkastningsindex: Nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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).

Värdet för MSCI Brazil Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEBRAF

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Brazil Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehåses av delfonden.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehåses 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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   | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI BRAZIL ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.



## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect ESG 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

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.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect ESG Filtered Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXCTIAEF

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect ESG Filtered Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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 börse 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 på högst 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 innehålla 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 Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI CHINA TECH ESG SCREENED ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI CHINA A II

## 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

Jämförelseindexet 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
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI China A Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NU718708

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI China A 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| Valuta               | Investeringsfond |
| Derivat              | Förvaltning      |
| Tillväxtmarknader    | Marknad          |
| Aktieexponering      | Volatilitet      |
| Indexreplikering     | Hållbarhet       |
| Indirekt replikering |                  |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF - USD | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI CHINA A II ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 FASTSTÄLLANDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRANSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

MSCI Emerging Markets Asia Index är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora företag i tillväxtländerna 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

- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet på MSCI Emerging Markets Asia Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGFA

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Emerging Markets Asia Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EM ASIA ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 FASTSTÄLLANDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, 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

MSCI Emerging Markets Latam Index 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

- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet på MSCI Emerging Markets Latam Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGFL

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Emerging Markets Latam Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

MSCI Emerging Markets Index 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
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Emerging Markets Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDUEEGF

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Emerging Markets Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 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

MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe ex Switzerland Index ("moderindexet") som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 14 länder med utvecklade marknader i Europa (per maj 2022), utom Schweiz, som är emitterade av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXECHENE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 %     | 0,05 %            | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS ("DELFONDEN") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH

(omformas per den 25.04.2024)

## 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

MSCI Europe Growth Index 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
- Indexsammansättning

MSCI Europe Growth 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 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe Growth Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSGEUNTR

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Growth 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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                      |                                       |
|----------------------|---------------------------------------|
| Valuta               | Investeringsfond                      |
| Derivat              | Förvaltning                           |
| Aktieexponering      | Marknad                               |
| Indexreplikering     | Hållbarhet                            |
| Indirekt replikering | Användning av tekniker och instrument |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 %               |

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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH

(gäller från den 25.04.2024)

## 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

MSCI Europe Growth Index 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
- Indexsammansättning

MSCI Europe Growth 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 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe Growth Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSGEUNTR

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Growth Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, 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

MSCI Europe High Dividend Yield Index 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

- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe High Dividend Yield Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M1EUHVDV

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe High Dividend Yield Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 %     | 0,13 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE HIGH DIVIDEND FACTOR ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 ÅR 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, SÄTTES 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, 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

MSCI Europe Minimum Volatility Index 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
- Indexsammansättning

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:

- 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.
- 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 korrelationerna mellan 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe Minimum Volatility Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MAEUVOE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Minimum Volatility Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### 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 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

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| Valuta               | Investeringsfond |
| Derivat              | Förvaltning      |
| Aktieexponering      | Marknad          |
| Indexreplikering     | Stil             |
| Indirekt replikering | Hållbarhet       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

| Andelsklass     | Valuta | Minsta initiala investering* | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|-----------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
|                 |        |                              | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY FACTOR ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UTFÅSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÅGARNÄR 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, SÄTTES 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, 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

MSCI Europe Momentum Index 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
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe Momentum Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MEUMMT

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Momentum Index. Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehåses av delfonden.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehåses 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE MOMENTUM FACTOR ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, 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

MSCI Europe Quality Index 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
- Indexsammansättning

MSCI Europe Quality 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 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

Ombalansering av indexet planeras halvårsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI ("MSCI").

MSCI: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).

Värdet för MSCI Europe Quality Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M7EUQU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Quality Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehas av delfonden följa 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 %     | 0,13 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, 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

MSCI Europe Value Index är ett aktieindex som är representativt för ledande aktier i industriländer i Europa (enligt definitionen i indexmetoden) som uppvisar övergripande värdeinriktningsegenskaper.

Indexet är ett nettoavkastningsindex: Nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe Value Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSVEUNTR

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Value Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehåses av delfonden.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehåses 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE VALUE FACTOR ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG. INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 LICENSIVARE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.



## 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

MSCI India Index 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
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI India Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDEUSIA

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI India Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF – EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,70 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – USD | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI INDIA ("DELFDONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

MSCI Nordic Countries Index 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

- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Nordic Countries Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDENCN

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Nordic Countries Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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 %     | 0,15 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI NORDIC ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 ÄGARNÄ 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 LICENSIVÄRE 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 HÄRMEDE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

MSCI Switzerland Index 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
- Indexsammansättning

Enligt MSCI-metoden strävar investeringsinriktningen för indexet till att täcka cirka 85 % (+/- 5 %) av den schweiziska marknaden 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Switzerland Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDESZN

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Switzerland Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

|                 |        |                              | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|-----------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
| Andelsklass     | Valuta | Minsta initiala investering* | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| UCITS ETF – CHF | CHF    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 0,10 %               |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI SWITZERLAND ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.



# AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 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

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index 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.

- Indexvaluta: US-dollar

- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXUSESL5

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehåses av delfonden.

I investeringsprocessen integrerar delfonden hållbarhetsrisker och beaktar investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, så som beskrivs närmare i avsnittet om "hållbara investeringar" i detta prospekt, och den kommer inte att innehålla 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 och kol enligt definitionen i "replikeringsmetoder".

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**Den tyska investeringsskattelagen:** Minst 90 % av delfondens substansvärde investeras alltid i aktier som är noterade på en börse 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 på högst 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

Derivat är en väsentlig del av delfondens investeringsstrategier. Delfonden kommer att växla resultatet för de tillgångar som innehåses 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                      |                                      |
|----------------------|--------------------------------------|
| Valuta               | Investeringsfond                     |
| Derivat              | Förvaltning                          |
| Aktieexponering      | Marknad                              |
| Indexreplikering     | Försäkringsbetalning och förlängning |
| Indirekt replikering | Hållbara investeringar               |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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 %     | 0,25 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS ("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-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 fransäger 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, skadestandsberättigande, 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

MSCI USA Minimum Volatility Index är ett aktieindex.

MSCI USA Minimum Volatility Strategy Index mäter resultatet för en minsta varianstrategi 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
- Indexsammansättning

Indexet beräknas genom optimering av MSCI USA Index, dess moderindex, i US-dollar för den lägsta absoluta risken (inom en given uppsättning begränsningar). Att sätta samman MSCI USA Minimum Volatility Strategy Index 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

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).

Värdet för MSCI USA Minimum Volatility Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: M1USMVOL

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI USA Minimum Volatility 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 %     | 0,08 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI USA MINIMUM VOLATILITY FACTOR ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UTFÅSTELSER 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

MSCI World Index 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
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI WORLD Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDEWIN

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI World Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF – EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,28 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – USD | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI WORLD ("DELFONDEN") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

MSCI World Index 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
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI WORLD Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: NDDUWI

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI World Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI WORLD III ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 ÄGARNÄ 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg BioEnergy 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

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.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

För att ett värdepapper ska väljas till Bloomberg BioEnergy ESG Index 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.

Värdet för Bloomberg BioEnergy ESG Index 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 [bloomberg.com](https://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 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 (marknadstillräde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden innehålla 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Valuta           | Förvaltning                           |
| Derivat          | Marknad                               |
| Aktieexponering  | Hållbara investeringar                |
| Indexreplikering | Användning av tekniker och instrument |
| Investeringsfond |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg BioEnergy ESG Index är servicemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och servicemärken och Bloomberg BioEnergy ESG Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED när Bloomberg BioEnergy ESG Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG BIOENERGY ESG INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG BIOENERGY ESG INDEX 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 ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG BIOENERGY ESG INDEX 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 SKADOR – VARE SIG DIREKTA, INDIREKTA, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED ELLER BLOOMBERG BIOENERGY ESG INDEX 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

MSCI World ex Europe Index 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

- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI World ex Europe Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MSDEWEUN

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI World ex Europe 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 "Replikeringmetoder för index och UCITS ETF-delfonder" i detta prospekt.

De största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UTFÅSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÅGARNA 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, SÄTTES 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 FASTSTÄLLANDE 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 ÅGARE 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 PÄLITLIGA 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, ÅGARE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

NASDAQ-100 Index 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 totalavkastningsindex: utdelningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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.

NASDAQ-100 Index beräknas av NASDAQ OMX med hjälp av de officiella stängningskurserna på den NASDAQ-börs där de värdepapper som ingår i indexet handlas.

Värdet för NASDAQ-100 Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: XNDX

Det resultat som följs är stängningskursen för NASDAQ-100 Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Nasdaq-indexet finns på [indexes.nasdaqomx.com](http://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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 - DAILY HEDGED EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,25 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – EUR              | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,13 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – USD              | USD    | 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](http://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 ANVÄNDNINGSSOMRÅDE 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.



## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för NYSE Arca Gold BUGS Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

NYSE Arca Gold BUGS Index är representativt för företag som ägnar sig åt guldgruvar. Indexet återspeglar kortsiktiga guldpriserörelser genom att inkludera företag som skyddar sin guldproduktion under en period på högst 1,5 år.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Vid varje ombalansering kommer de tre största indexkomponenterna baserat på börsvärde att inkluderas i indexberäkningen med en högre procentsats än de återstående företagen. De återstående företagen kommer att vara lika viktade. Om en aktie får ingå i indexet beror på börsvärdet, handelsvolymen och ett antal andra kriterier som beskrivs i indexmetoden.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av ICE Data Indices, LLC.

NYSE Arca Gold BUGS Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: HUIINTR

Det resultat som följs är stängningskursen för NYSE Arca Gold BUGS Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i index från ICE Data Indices, LLC finns på [indices.theice.com](http://indices.theice.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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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 totalavkastningssvappar 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Koncentration    | Marknad                               |
| Derivat          | Aktier i små och medelstora företag   |
| Aktieexponering  | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,55 %            | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

ICE Data Indices, LLC ("ICE Data"), används med tillstånd. NYSE® och NYSE Arca Gold BUGS Index® är service-/varumärken som tillhör ICE Data Indices, LLC eller dess närstående företag och har licensierats tillsammans med NYSE Arca Gold BUGS Index ("index") för användning av förvaltningsbolaget ("licenstagaren") i samband med AMUNDI NYSE ARCA GOLD BUGS ("produkten"). Varken licenstagaren eller produkten sponsras, rekommenderas, säljs eller marknadsförs av ICE Data Indices, LLC, dess närstående företag eller dess tredjepartsleverantörer ("ICE Data och dess leverantörer"). ICE Data och dess leverantörer gör inga utfästelser och lämnar inga garantier om lämpligheten för någon investering i värdepapper i allmänhet, i produkten i synnerhet eller indexets förmåga att följa den allmänna aktiemarknadens resultat. ICE Datas enda relation till licenstagaren är licensiering av vissa varumärken och handelsnamn och indexet eller dess komponenter. Indexet fastställs, sätts samman och beräknas av ICE Data utan hänsyn till licenstagaren eller produkten eller innehavarna av denna. ICE Data har ingen skyldighet att ta hänsyn till licenstagaren eller till innehavarna av produkten när indexet fastställs, sätts samman eller beräknas. ICE Data ansvarar inte för och har inte deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter som erbjuds med avseende på produkten eller beräkningsmetoden genom vilken produkten ska kurs sättas, säljas, köpas eller lösas in. Med undantag för vissa anpassade indexberäkningstjänster är all information som tillhandahålls av ICE Data av allmän karaktär och inte skräddarsydd efter behoven för licenstagaren eller någon annan person, enhet eller grupp av personer. ICE Data har inga skyldigheter eller ansvar i samband med administration, marknadsföring eller handel med produkterna. ICE Data är ingen investeringsrådgivare. Att ett värdepapper tas med i ett index innebär inte att ICE Data rekommenderar att köpa, sälja eller inneha ett sådant värdepapper och det anses inte heller vara investeringsrådgivning.

ICE DATA OCH DESS LEVERANTÖRER FRISKRIVER SIG FRÅN ALLA GARANTIER OCH UTFÄSTELSER, UTTRYCKLIGA OCH/ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, INKLUSIVE GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNING, INKLUSIVE INDEX, INDEXDATA OCH INFORMATION SOM FINNS I, ÄR RELATERAD TILL ELLER HÄRRÖR FRÅN DEM ("INDEXDATA"). ICE DATA OCH DESS LEVERANTÖRER SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR OM INDEX OCH INDEXDATA ÄR TILLRÄCKLIGA, KORREKTA, AKTUELLA ELLER FULLSTÄNDIGA, OCH DE TILLHANDAHÅLLS I BEFINTLIGT SKICK OCH ANVÄNDNINGEN SKER PÅ ANVÄNDARENS EGEN RISK

# 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

Dow Jones Industrial Average Index 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
- Indexsammansättning

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").

Värdet för Dow Jones Industrial Average Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: DJINR

Det resultat som följs är stängningskursen för Dow Jones Industrial Average Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                                  |                  |
|--------------------------------------------------|------------------|
| Valuta                                           | Investeringsfond |
| Derivat                                          | Förvaltning      |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 %     | 0,35 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF - USD | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI PEA DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG ("S&P"). S&P GER INTE NÅGRA UTFÄSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA, 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 S&P 500 INDEX 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 S&P 500, 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 S&P 500 INDEX FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLET 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 S&P 500 INDEX 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 UNDERFÖRSTÄDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV S&P 500-INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE SKA S&P UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER HA NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV S&P 500 ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Russel 2000 Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Russel 2000 Index 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
- Indexsammansättning

Russell 2000 Index är en underkategori till Russell 3000 Index, som representerar cirka 99 % av den amerikanska aktiemarknaden.

Russell 2000 Index 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"
- slutna 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.

Russel 2000 Index beräknas med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet för Russell 2000 Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: RU20N30U

Det resultat som följs är stängningskursen för Russell 2000 Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Russell-index finns på [ftse.com](http://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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                      |                                     |
|----------------------|-------------------------------------|
| Valuta               | Investeringsfond                    |
| Derivat              | Förvaltning                         |
| Aktieexponering      | Marknad                             |
| Indexreplikering     | Aktier i små och medelstora företag |
| Indirekt replikering | Hållbarhet                          |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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 %     | 0,25 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Russell 2000 ("indexet") är ett varumärke som tillhör Frank Russell Company ("Russell") och har licensierats för användning av Amundi Asset Management. AMUNDI RUSSELL 2000 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 AMUNDI RUSSELL 2000 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 AMUNDI RUSSELL 2000. 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.

## 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

S&P500 Index 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
- Indexsammansättning

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").

S&P 500 Index beräknas av S&P med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet för S&P 500 Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPTR500N

Det resultat som följs är stängningskursen för S&P 500 Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 - DAILY HEDGED EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,18 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – EUR              | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,05 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – USD              | USD    | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

### Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI S&P 500 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 UNDERFÖRSTÄDDA, TILL ÅGARNA AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS S&P 500 INDEX 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 S&P 500, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 S&P 500 INDEX FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 S&P 500 INDEX 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 UNDERFÖRSTÄDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV S&P 500-INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER, UTFÄSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV S&P 500 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

S&P 500 Buyback Index 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
- Indexsammansättning

S&P 500 Buyback Index 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 tolv månadersperioden. Aktierna i S&P 500 Buyback Index 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").

S&P 500 Buyback Strategy Index beräknas med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets aktiekomponenter handlas.

Värdet för S&P 500 Buyback Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPBUYUN

Det resultat som följs är stängningskursen för S&P 500 Buyback Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 %     | 0,05 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – USD | USD    | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI S&P 500 BUYBACK SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ("S&P"). S&P GER INTE NÅGRA UTFÅSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÅGARNAS AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS S&P 500 INDEX 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 S&P 500, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 S&P 500 INDEX FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FONDANDELARNAS 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 S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÅSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV S&P 500-INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÅSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV S&P 500 ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

S&P Global Luxury Index 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
- Indexsammansättning

Investeringsområdet utgörs av aktier noterade på börser på utvecklade och tillväxtmarknader. Varje aktie tilldelas ett "lyxexponeringsbetyg" (luxury exposure score) grundat på verksamhetsbeskrivning, intäktsegment 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").

S&P Global Luxury Index beräknas av S&P med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet för S&P Global Luxury Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPGLGUN

Det resultat som följs är stängningskursen för S&P Global Luxury Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF – EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF – 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG ("S&P"). S&P GER INTE NÅGRA UTFÅSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, TILL ÅGARNAS AV DELFONDEN ELLER NÅGON I ALLMÄNHETEN BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I VÄRDEPAPPER I ALLMÄNHET ELLER I DELFONDEN I SYNNERHET ELLER FÖRMÅGAN HOS S&P 500 INDEX 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 S&P 500, 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 S&P 500 INDEX FASTSTÄLLS, SÄTTS SAMMAN ELLER BERÄKNAS. S&P ANSVARAR INTE FÖR OCH HAR INTE DELTAGIT VID FASTSTÄLLET AV DELFONDENS KURSER OCH SUBSTANSVÄRDE, TIDPUNKTEN FÖR EMISSION ELLER FÖRSÄLJNING AV DELFONDEN ELLER VID FASTSTÄLLET ELLER BERÄKNINGEN AV DEN EKVATION ENLIGT VILKEN FONDANDELARNAS 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 S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÅSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV S&P 500-INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, UTFÅSTELSER 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, INDIREKTA ELLER FÖLJDSKADOR (INKLUSIVE FÖRLORADE VINSTER) SOM UPPSTÅR TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV S&P 500 ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Solactive Smart City Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Indexet strävar efter att återspegla resultatet för aktier i företag som verkar inom branscher som är relaterade till utvecklingen av morgondagens städer. I synnerhet är relevanta företag verksamma inom någon av följande sex kategorier: Offentlig infrastruktur, teknik, e-handel, smarta hem, underhållning och sjukvård (var och en en "kategori").

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Per den 29 mars 2019 är 64 olika branscher knutna till de sex kategorierna.

De aktier som ingår i indexet är primärnoterade i ett av de länder som är del av de utvecklade marknaderna och tillväxtmarknaderna enligt definitionen i Solactive Country Classification (se <https://www.solactive.com/documents/>). Aktier som är noterade på Shanghai-börsen eller Shenzhen-börsen måste vara tillgängliga för köp och försäljning via programmet Northbound Stock Connect.

Företag som ingår i indexet måste generera minst 50 % av sina årliga intäkter från en eller flera fördefinierade branscher som är relevanta för temat smart stad.

För att tas med i indexet måste aktierna ha ett minsta börsvärde på 1 miljard EUR och ett minsta genomsnittligt handelsvärde på 5 miljoner EUR under 1 månad och under 6 månader före och inklusive urvalsdagen.

Dessutom kontrolleras företagen beträffande sin verksamhet inom kontroversiella vapen. Om de medför kontroverser eller risker i förhållande till FN-initiativet Global Compacts principer (normbaserad analys) utesluts de.

Varje urvalsdag får varje kategori en vikt som motsvarar 100 % dividerat med antalet kategorier (6) i indexet.

I varje kategori viktas komponenterna lika med en maximal enskild vikt på 2 %.

Om det finns färre än 10 komponenter i en kategori, kommer den ytterligare vikt som inte kan allokteras till dessa komponenter med hänsyn till den maximala vikten på 2 % att fördelas lika bland alla andra indexkategorier.

I indexet ingår beståndsdelar med litet, medelstort och stort börsvärde.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive ("MSCI").

Solactives 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).

Värdet på Solactive Smart City Index tillhandahålls via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLSCNTR

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive Smart City Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](https://www.solactive.de)

## 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.

### 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 på högst 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 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Valuta                                           | Investeringsfond                      |
| Derivat                                          | Förvaltning                           |
| Tillväxtmarknader                                | Marknad                               |
| Aktieexponering                                  | Aktier i små och medelstora företag   |
| Indexreplikering                                 | Hållbara investeringar                |
| Indirekt replikering                             | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF   | 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](https://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 SMART CITIES ESG SCREENED

(gäller från den 19.04.2024)

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI ACWI IMI Smart Cities ESG 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 utesluter företag som utesluter företag som ligger efter med miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG") i förhållande till temats område, vilket beskrivs närmare i bilaga I – ESG-relaterade upplysningar till delfondens prospekt.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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 mobilteknik
- Smart avfalls- och vattenhantering
- Smart energi och elnät

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av MSCI ("MSCI").

MSCI ACWI IMI Smart Cities ESG-filtrerade officiella index är de som beräknas av MSCI med hjälp av:

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

Värdet för MSCI ACWI IMI Smart Cities ESG Filtered Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXACSMRT

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI ACWI IMI Smart Cities ESG Filtered Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 2 %. 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 innehålla 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

|                                                                          |                                       |
|--------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI SMART CITIES ESG SCREENED ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRANSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Solactive Smart Factory Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Indexet strävar efter att återspegla resultatet för aktier i företag som verkar inom branscher knutna till temat smart fabrik, dvs. omvandlingen av tillverkningsindustrin och den industriella marknaden i allmänhet genom ny teknik och innovationer. I synnerhet är relevanta företag verksamma inom någon av följande fem kategorier: Avancerad robotteknik, moln och stordata, IT-säkerhet, förstärkt verklighet och 3D-utskrift och sakernas internet (IoT) (var och en en "kategori").

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Per den 29 mars 2019 är 30 olika branscher knutna till de fem kategorierna. De aktier som ingår i indexet är primärnoterade i ett av de länder som är del av de utvecklade marknaderna och tillväxtmarknaderna enligt definitionen i Solactive Country Classification (se <https://www.solactive.com/documents/>). Aktier som är noterade på Shanghai-börsen eller Shenzhen-börsen måste vara tillgängliga för köp och försäljning via programmet Northbound Stock Connect.

Företag som ingår i indexet måste generera minst 50 % av sina årliga intäkter från en eller flera fördefinierade branscher som är relevanta för temat smart fabrik.

För att tas med i indexet måste aktierna ha ett minsta börsvärde på 1 miljard EUR och ett minsta genomsnittligt handelsvärde på 5 miljoner EUR under 1 månad och under 6 månader före och inklusive urvalsdagen.

Dessutom kontrolleras företagen beträffande sin verksamhet inom kontroversiella vapen. Om de medför kontroverser eller risker i förhållande till FN-initiativet Global Compacts principer (normbaserad analys) utesluts de.

Varje urvalsdag får varje kategori en vikt som motsvarar 100 % dividerat med antalet kategorier (5) i indexet.

I varje kategori viktas komponenterna lika med en maximal enskild vikt på 2 %.

Om det finns färre än 10 komponenter i en kategori, kommer den ytterligare vikt som inte kan allokteras till dessa komponenter med hänsyn till den maximala vikten på 2 % att fördelas lika bland alla andra indexkategorier.

I indexet ingår beståndsdelar med litet, medelstort och stort börsvärde.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Solactive Smart Factorys 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).

Värdet på Solactive Smart Factory Index tillhandahålls via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLSFN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive Smart Factory Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://solactive.de)

## 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                      |                  |
|----------------------|------------------|
| Valuta               | Investeringsfond |
| Derivat              | Förvaltning      |
| Aktieexponering      | Marknad          |
| Indexreplikering     | Hållbarhet       |
| Indirekt replikering |                  |

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| 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](http://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.

## 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

STOXX Europe 600 Index 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
- Indexsammansättning

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 .

Värdet för STOXX Europe 600 Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SXXR

Det resultat som följs är stängningskursen för STOXX Europe 600 Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stoxx.com](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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 totalavkastningssvappar 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                   |                                       |
|-----------------------------------|---------------------------------------|
| Valuta                            | Förvaltning                           |
| Derivat                           | Marknad                               |
| Aktieexponering                   | Aktier i små och medelstora företag   |
| Säkringsrisk (säkrad andelsklass) | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,02 %            | 0,05 %               |
| UCITS ETF DIST            | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,03 %            | 0,04 %               |
| 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](http://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 STOXX Europe 600 Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI STOXX EUROPE 600.

STOXX och dess licensgivare:

- sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte AMUNDI STOXX EUROPE 600.
- rekommenderar inte att någon ska investera i AMUNDI STOXX EUROPE 600 eller andra värdepapper.
- har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av AMUNDI STOXX EUROPE 600.
- har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av AMUNDI STOXX EUROPE 600.
- beaktar inte behoven hos AMUNDI STOXX EUROPE 600 eller ägarna av AMUNDI STOXX EUROPE 600 när STOXX Europe 600 Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI STOXX EUROPE 600. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
- De resultat som kan erhållas av AMUNDI STOXX EUROPE 600, ägarna av AMUNDI STOXX EUROPE 600 eller andra personer i samband med användningen av STOXX Europe 600 Index och data i STOXX Europe 600® Index.
- Att STOXX Europe 600 Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av STOXX Europe 600 Index® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i STOXX Europe 600 Index® 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 AMUNDI STOXX EUROPE 600 eller andra tredje parter.



# AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI ACWI IMI Robotics & AI ESG Filtered 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 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.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Indexet har följande egenskaper:

- Samma investeringsområde som MSCI ACWI Investable Market Index (IMI) ("moderindexet"), dvs. inklusive aktier i stora, medelstora och små företag i utvecklade länder och tillväxtländer.
- 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.
- Företag från det godtagbara investeringsområdet med ett "relevansbetyg" (enligt definitionen av MSCI) över 25 % utgör det "valda investeringsområdet".
- Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sektor tillämpas på det valda investeringsområdet.
- 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI ACWI IMI Robotics & AI ESG Filtered Net Total Return Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXACIREF

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI ACWI IMI Robotics & AI ESG Filtered Net Total Return Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehå 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRANSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, 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

Solactive GBS Emerging Markets Large & Mid Cap USD Index 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
- Indexsammansättning

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.

Solactive GBS Emerging Markets Large & Mid Cap USD Index är det sammanlagda antalet utvalda aktier i varje land.

Aktierna viktas enligt deras fria omsättningsbara börsvärde.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Värdet på Solactive GBS Emerging Markets Large & Mid Cap USD Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SEMLMCUN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive GBS Emerging Markets Large & Mid Cap USD Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 2 %. 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 innehålla positioner 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                   |                                       |
|-------------------|---------------------------------------|
| Valuta            | Investeringsfond                      |
| Derivat           | Förvaltning                           |
| Tillväxtmarknader | Marknad                               |
| Aktieexponering   | Hållbarhet                            |
| Indexreplikering  | Användning av tekniker och instrument |
| Landrisk – Kina   |                                       |

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://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.

## 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

Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index 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
- Indexsammansättning

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.

Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap Index är det sammanlagda antalet utvalda aktier i 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).

Värdet på Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SEULMCEN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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

|                                                                          |                                       |
|--------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 %     | 0,03 %            | 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](https://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.

## 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

Solactive GBS Developed Markets Eurozone Large & Mid Cap Index 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
- Indexsammansättning

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.

Solactive GBS Developed Markets Eurozone Large & Mid Cap Index beräknas dagligen med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet för Solactive GBS Developed Markets Eurozone Large & Mid Cap Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SEZLMCN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive GBS Developed Markets Eurozone Large & Mid Cap Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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.

### 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 på högst 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 innehålla 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 %     | 0,03 %            | 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](https://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.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap USD Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets utveckling.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap USD Index är ett aktieindex som är representativt för stora och medelstora bolag i 23 industriländer.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Indexkomponenterna är noterade och handlas i 23 industriländer: Australien, Österrike, Belgien, Kanada, Danmark, Finland, Frankrike, Tyskland, Hongkong, Irland, Israel, Italien, Japan, Nederländerna, Nya Zeeland, Norge, Portugal, Singapore, Spanien, Sverige, Schweiz, Storbritannien, USA.

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.

Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap Index är det sammanlagda antalet utvalda aktier i 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).

Värdet på Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap USD Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SDMLMCUN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap USD Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](https://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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| UCITS ETF DR | 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](https://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.

## 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

Solactive GBS Japan Large & Mid Cap Index 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
- Indexsammansättning

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).

Värdet på Solactive GBS Japan Large & Mid Cap Index finns 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 [solactive.de](http://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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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:** Japansk yen

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://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

Solactive United Kingdom Mid and Small Cap ex Investment Trust Index är ett aktieindex som är representativt för marknaderna med medelstora och små bolag 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
- Indexsammansättning

Det inledande investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet, Solactive GBS United Kingdom All Cap. 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 uteslagna 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.

Värdet för Solactive United Kingdom Mid and Small Cap ex Investment Trust Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLUKMSN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive United Kingdom Mid and Small Cap ex Investment Trust Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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:** Brittiska pund

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 instrument |
| Marknad          |                                       |

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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](https://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.



## 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

Solactive GBS United States Large & Mid Cap Index 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
- Indexsammansättning

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).

Värdet på Solactive GBS United States Large & Mid Cap Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SUSLMCN

Det resultat som följs är stängningskursen för Solactive GBS United States Large & Mid Cap Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |

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](https://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 INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB

## 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

MSCI EM Asia SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets (EM) ("överordnat index"), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag i nio asiatiska 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 viktat 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).

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI EM Asia SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EM Asia SRI Filtered PAB Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXMSFFNU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EM Asia SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

|              |        |                              | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|--------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
| Andelsklass  | Valuta | Minsta initiala investering* | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| IE           | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EM (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

MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets Index ("överordnat index"), 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 viktat 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).

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEFSXNU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 2 %. 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 innehålla 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:** 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

|              |        |                              | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|--------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
| Andelsklass  | Valuta | Minsta initiala investering* | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| AE           | USD    | –                            | 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    | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB ("DELFONDEN") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 ÄGARNÄR 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för MSCI EMU 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

MSCI EMU SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU index ("överordnat index"), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag på tio utvecklade marknader inom EMU (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 viktat 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).

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI EMU SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EMU SRI Filtered PAB Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMXNE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EMU SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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".

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB ("Delfonden") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER 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 NÄRSTÄENDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för MSCI Europe 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

MSCI Europe SRI Filtered PAB Index 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 viktat 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).

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI Europe SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe SRI Filtered PAB Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUSXNE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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 %               |
| IE           | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,13 %            | 0,05 %               |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE 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 FASTSTÄLLANDE 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 PÄLITLIGA 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 FRANSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.



# AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB

## 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

MSCI Japan SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI World Index ("överordnat index"), som är representativt för 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 viktat 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).

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

- Indexvaluta: Japansk yen
- Indexsammansättning

MSCI Japan SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Japan SRI Filtered PAB Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXJPSXNY

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Japan SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** Japansk yen

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

|                        |        |                              | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|------------------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
| Andelsklass            | Valuta | Minsta initiala investering* | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| UCITS ETF – CHF HEDGED | CHF    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR           | JPY    | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB ("Delfonden") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄ 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB

## 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

MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI Pacific ex Japan Index och är representativt för stora och medelstora företag i 4 av 5 industriländer i Stilla-havsområdet undantaget Japan (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).

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXPJSXNE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### 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 innehålla 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 Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utförd för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| AE                 | EUR    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 0,15 %               |
| IE                 | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB ("DOLFONDEN") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNA I DENNA DOLFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERA I DOLFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DOLFOND 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 DOLFOND, DENNA DOLFONDS ANDELSINNEHAVARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER.

INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÅGON SKYLDIGHET ATT TA HÄNSYN TILL BEHOVEN HOS AMUNDI, DOLFONDENS 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 DOLFOND ELLER VID FASTSTÄLLANDE ELLER BERÄKNING AV DEN EKVATION ENLIGT ELLER ERSÄTTNING MOT VILKEN DENNA DOLFOND KAN LÖSAS IN. DESSUTOM HAR INGEN AV MSCI-PARTERNA SKYLDIGHETER ELLER ANSVAR GENTEMOT DOLFONDENS EMITTENT ELLER ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER I SAMBAND MED ADMINISTRATION, MARKNADSFÖRING ELLER ERBJUDANDE AV DENNA DOLFOND.

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 UNDERFÖRSTÄDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DOLFONDENS 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för MSCI USA 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

MSCI USA SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI USA Index som är representativt för 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).

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI USA SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI USA SRI Filtered PAB Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXUSSXNU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI USA SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

|             |        |                              | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|-------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
| Andelsklass | Valuta | Minsta initiala investering* | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| AE          | USD    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,20 %            | 0,15 %               |
| IE          | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,13 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB ("DELFONDEN") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för MSCI World 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

MSCI World SRI Filtered PAB Index 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 viktat 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).

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI World SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI World SRI Filtered PAB Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXWOSXNU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI World SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

|             |        |                              | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|-------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
| Andelsklass | Valuta | Minsta initiala investering* | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| AE          | USD    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,20 %            | 0,15 %               |
| IE          | EUR    | 500 000 USD                  | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB ("DELFONDEN") SPONSERAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI UK IMI 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

MSCI UK IMI SRI Filtered PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI United Kingdom IMI Index som är representativt för stora, medelstora och små företag på den brittiska marknaden ("moderindexet"). Indexet ger exponering mot företag som har högsta betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor hos moderindexet, och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktat 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).

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

- Indexvaluta: Brittiska pund
- Indexsammansättning

MSCI UK IMI SRI Filtered PAB Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI UK IMI SRI Filtered PAB Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXGBISNG

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI UK IMI SRI Filtered PAB Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 (marknadstillräde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden innehå 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB ("Delfonden") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UNDERFÖRSTÄTT, 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, SÄTTES 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 FASTSTÄLLANDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.



## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för DAX 50 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

DAX 50 ESG följer resultatet för de 50 största aktierna med jämförbart goda resultat baserat på deras miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier. Indexet utgörs av värdepapper som ingår i HDAX index som är representativt för stora och mellanstora bolag handlade på den tyska aktiemarknaden och har juridiskt säte eller verksamhetssäte i Tyskland. HDAX består av de bolag som ingår i DAX (tyskt index för stora tyska bolag som följer resultatet för de 40 största bolagen på den tyska aktiemarknaden baserat på börsvärde och omsättning), MDAX (som består av de 50 bolag som kommer efter de bolag som ingår i DAX baserat på börsvärde och omsättning) och TecDAX (som består av de 30 största och mest likvida teknikvärdepapperen baserat på börsvärde och omsättning).

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Indexets investeringsområde definieras av alla aktier som ingår i HDAX 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 STOXX .

Värdet för DAX 50 ESG Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: DAXESGN

Det resultat som följs är stängningskursen för DAX 50 ESG Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stxx.com](https://stxx.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 innehålla 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".

### Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

**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.

### 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 på högst 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 innehå 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 | 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](http://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 DAX 50 ESG Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI DAX 50 ESG.

STOXX och dess licensgivare:

- sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte AMUNDI DAX 50 ESG.
- rekommenderar inte att någon ska investera i AMUNDI DAX 50 ESG eller andra värdepapper.
- har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av AMUNDI DAX 50 ESG.
- har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av AMUNDI DAX 50 ESG.
- beaktar inte behovet hos AMUNDI DAX 50 ESG eller ägarna av AMUNDI DAX 50 ESG när DAX 50 ESG Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI DAX 50 ESG. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
- De resultat som kan erhållas av AMUNDI DAX 50 ESG, ägare av AMUNDI DAX 50 ESG eller andra personer i samband med användningen av DAX 50 ESG Index och data i DAX 50 ESG Index®.
- Att DAX 50 ESG Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av DAX 50 ESG Index® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för fel, utelämnanden eller avbrott i DAX 50 ESG Index® eller dess data.
- STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadestandsberättigande, 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 AMUNDI DAX 50 ESG eller andra tredje parter.

## 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

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.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Målet för MDAX ESG+ (NR) EUR index är att återspegla MDAX-indexets resultat och samtidigt använda ESG-uteslutningsfilter för att ta bort minst 20 % av beståndsdelarna i MDAX, 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 .

Värdet för MDAX ESG+ (NR) EUR Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MDXESGPN

Det resultat som följs är stängningskursen för MDAX ESG+ (NR) EUR Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stoxx.com](http://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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Derivat                                          | Marknad                               |
| Aktieexponering                                  | Aktier i små och medelstora företag   |
| Indexreplikering                                 | Volatilitet                           |
| Investeringsfond                                 | Hållbara investeringar                |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,20 %            | 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](http://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 MDAX ESG+ (NR) EUR Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI MDAX ESG.

STOXX och dess licensgivare:

- sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte AMUNDI MDAX ESG.
- rekommenderar inte att någon ska investera i AMUNDI MDAX ESG eller andra värdepapper.
- har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller kurser för AMUNDI MDAX ESG.
- har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av AMUNDI MDAX ESG.
- beaktar inte behovet hos AMUNDI MDAX ESG eller ägarna av AMUNDI MDAX ESG när MDAX ESG+ (NR) EUR Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI MDAX ESG. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
  - De resultat som kan uppnås av AMUNDI MDAX ESG, ägare av AMUNDI MDAX ESG eller andra personer i samband med användningen av MDAX ESG+ (NR) EUR Index och data i MDAX ESG+ (NR) EUR Index®.
  - Att MDAX ESG+ (NR) EUR Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
  - Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av MDAX ESG+ (NR) EUR Index® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för fel, utelämnanden eller avbrott i MDAX ESG+ (NR) EUR Index® 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 AMUNDI MDAX ESG eller andra tredje parter.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för S&P 500 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

S&P 500 ESG+ Index ("indexet") är ett brett index, viktat enligt ett tak för börsvärde, som mäter utvecklingen för värdepapper som uppfyller hållbarhetskriterier, samtidigt som det bevarar en sammanvägning av branschgruppsviktning som den i S&P 500 ("moderindexet"). 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
- Indexsammansättning

Det inledande investeringsområdet för S&P 500 ESG+ 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").

S&P 500 ESG+ Index beräknas av S&P med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet för S&P 500 ESG+ Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SPXESAUN

Det resultat som följs är stängningskursen för S&P 500 ESG+ Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i S&P-index finns på [eu.spindices.com](http://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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %            | 0,15 %               |
| IE          | EUR    | 500 000 USD                  | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI S&P 500 ESG SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV STANDARD & POOR'S ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG ("S&P"). S&P GER INTE NÅGRA UTFÅSTELSER, VILLKOR ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA, 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 S&P 500 INDEX 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 S&P 500, SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 S&P 500 INDEX FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI OCH S&P HAR INGET ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRI. S&P GER INGA GARANTIER, VILLKOR ELLER UTFÅSTELSER, VARE SIG UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA, OM RESULTAT SOM AMUNDI, INVESTERARE ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET ERHÅLLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV S&P 500-INDEXET ELLER DATA DÄRI. S&P GER INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER, UTFÅSTELSER ELLER VILLKOR, OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER ELLER VILLKOR OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE OCH ALLA ANDRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER ELLER VILLKOR MED AVSEENDE PÅ S&P 500 INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE 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 S&P 500 ELLER DATA DÄRI, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN FÖR SÅDANA SKADOR.

## 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

STOXX EUROPE 600 ESG+ Index är ett aktieindex som är baserat på Stoxx Europe 600 (moderindex) 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 är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro

- Indexsammansättning

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.

Indexet beräknas dagligen med hjälp av de officiella stängningskurserna på de börser där indexets komponenter handlas.

Värdet för STOXX Europe 600 ESG+ Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SXXRESGP

Det resultat som följs är stängningskursen för STOXX Europe 600 ESG+ Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stoxx.com](http://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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 (marknadstillräde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden innehålla 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

Fonden 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 |

### 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 %     | 0,08 %            | 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](https://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 STOXX Europe 600 ESG+ Index® och relaterade varumärken för användning i samband med Amundi Stoxx Europe 600 ESG.

STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför Amundi Stoxx Europe 600 ESG.
- Rekommenderar att någon ska investera i Amundi Stoxx Europe 600 ESG eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av Amundi Stoxx Europe 600 ESG.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av Amundi Stoxx Europe 600 ESG.
- Beaktar behovet hos Amundi Stoxx Europe 600 ESG eller ägarna av Amundi Stoxx Europe 600 ESG när STOXX Europe 600 ESG+ Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till Amundi Stoxx Europe 600 ESG. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
- De resultat som kan erhållas av Amundi Stoxx Europe 600 ESG, ägare av Amundi Stoxx Europe 600 ESG eller andra personer i samband med användningen av STOXX Europe 600 ESG+ Index och data i STOXX Europe 600 ESG+ Index®.
- Att STOXX Europe 600 ESG+ Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av STOXX Europe 600 ESG+ Index® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i STOXX Europe 600 ESG+ Index® 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 Amundi Stoxx Europe 600 ESG eller andra tredje parter.



# AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 5% Issuer Capped ("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 MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 5% Issuer Capped är ett aktieindex baserat på MSCI AC Far East ex Japan Index ("moderindexet"), som är representativt för stora och medelstora företag i två industriländer (Japan undantaget) och 7 tillväxtmarknadsländer i Fjärran Östern och emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet på indexet MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 5% Issuer Capped finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXACFENU

Det resultat som fastställs är stängningskursen för indexet MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 5% Issuer Capped.

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 innehålla 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 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 2 %. 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UTFÅSTELSER 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, SÄTTES 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI China ESG Leaders Select 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

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 denominerade i US-dollar emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade utslutningar 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI China ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXCNEGNU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI China ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

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

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT ("DELFDONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 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

MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets ex China Index ("moderindex"), 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.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade utslutningar 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 utifrån:

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

Värdet på MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEFEGNU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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           | EUR    | 500 000 USD                  | 3,50 %                           | 1,00 %     | 0,25 %            | 0,10 %               |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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, SÄTTES 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 FRÄNSÄGER 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped 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

MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped Index 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 är ett nettoberäknat totalavkastningsindex: nettoutdelningen efter skatt som betalas ut av indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet på MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEME5NU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 2 %. 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS ("DELFDONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄR 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 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

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.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper i moderindexet.

Värdepapperen väljs genom att tillämpa en kombination av värdebaserade utslutningar 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMUEL5

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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".

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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.

### 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 på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### Tekniker och instrument för värdepapper och derivat

För att hantera inflöden och utflöden samt vissa egenheter på den lokala marknaden (marknadstillräde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden innehå 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %            | 0,15 %               |
| IE                 | EUR    | 500 000 USD                  | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRANSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa utvecklingen för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped 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

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXUSESL5

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE 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 UNIVERSAL SELECT

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EMU ESG UNIVERSAL 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

MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT är ett aktieindex baserat på MSCI EMU Index ("moderindex"), representativt för de stora och mellanstora företagens värdepapper i 10 industriländer i EMU. Indexet syftar till att representera resultatet av en strategi som ökar exponeringen jämfört med moderindexet för företag med både en robust ESG-profil samt en positiv tendens att förbättra den ESG-profilen. Metoden syftar till att justera beståndsdelarna för viktningen av "fritt omsättbara aktier" baserat på vissa mått av miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG").

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Det godtagbara investeringsområdet definieras genom att utesluta värdepapper från moderindexets investeringsområde, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMESUS

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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".

### Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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 %     | 0,05 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT ("DELFONDEN") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER 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 NÄRSTÄENDE 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI WORLD ESG UNIVERSAL 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

MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindex"), representativt för de stora och mellanstora marknaderna i 23 industriländer. Indexet syftar till att representera resultatet av en strategi som ökar exponeringen jämfört med moderindexet för företag med både en robust ESG-profil samt en positiv tendens att förbättra den ESG-profilen. Metoden syftar till att justera beståndsdelarna för viktningen av "fritt omsättbara aktier" baserat på vissa mått av miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG").

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Det godtagbara investeringsområdet definieras genom att utesluta värdepapper från moderindexets investeringsområde, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXWOESUS

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

| Andelsklass | Valuta | Minsta initiala investering* | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|-------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
|             |        |                              | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÅSTELSER 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 NÄRSTÄENDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EUROPE CLIMATE TRANSITION CTB

(omformas per den 02.02.2024)

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI Europe Climate Change CTB Select Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

MSCI Europe Climate Change CTB Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index ("överordnat index"), som är representativt för värdepapper med stort och medelstort börsvärde i 15 länder med utvecklade marknader i Europa (per december 2020). Indexet syftar till att representera resultatet för en strategi som viktat 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.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Indexet strävar efter att minska sin växthusgasintensitet med minst 30 % jämfört med moderindexet och är avsett att uppfylla målet att minska koldioxidutsläppen med 7 % jämfört med föregående år, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe Climate Change CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUTBNE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Climate Change CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehå 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehå 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Valuta           | Förvaltning                           |
| Derivat          | Marknad                               |
| Aktieexponering  | Stil                                  |
| 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 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".

Tidsgräns för transaktioner: 14:00 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 %     | 0,42 %            | 0,08 %               |
| IE           | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE CLIMATE TRANSITION CTB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, 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 NÄRSTÄENDE 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION

(gäller från den 02.02.2024)

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered 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

MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index ("överordnat index"), 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.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Index 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).

Värdet för MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Net EUR Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUPFNE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Net EUR Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### 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 innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**Byta in/ut** Tillåtet

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

| Andelsklass  | Valuta | Minsta initiala investering* | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|--------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
|              |        |                              | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| AE           | EUR    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,42 %            | 0,08 %               |
| IE           | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLYVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄ I DENNA DELFOND ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER BETRÄFFANDE LÄMPLIGHETEN I ATT INVESTERÄ I DELFONDER I ALLMÄNHET ELLER I DENNA DELFOND I SYNNERHET ELLER MSCI-INDEXENS FÖRMÄGA ATT FÖLJA UTVECKLINGEN PÄ MOTSVARANDE AKTIEMARKNAD. MSCI ELLER DESS NÄRSTÄENDE 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 NÄGON 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 INGÄ ELLER ANVÄNDAS VID BERÄKNINGEN AV MSCI-INDEXEN FRÄN KÄLLOR SOM MSCI ANSER ÄR PÄLITLIGA GARANTERAR INGEN AV MSCI-PARTERNA ATT MSCI-INDEX ELLER DATA I DEM ÄR URSPRUNGLIGA, KORREKTA OCH/ELLER FULLSTÄNDIGA. INGEN AV MSCI-PARTERNA GER NÄGRA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA, OM VILKA RESULTAT SOM DELFONDENS EMITTENT, ÄGARE ELLER ANDRA FYSISKA ELLER JURIDISKA PERSONER KAN VÄNTA SIG VID ANVÄNDNING AV NÄGOT MSCI-INDEX ELLER NÄGRA DATA SOM INGÄR I DEM. INGEN AV MSCI-PARTERNA HAR NÄGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT I ELLER I SAMBAND MED NÄGOT MSCI-INDEX ELLER NÄGRA DATA SOM INGÄR I DEM. DESSUTOM GER INGEN AV MSCI-PARTERNA NÄGRA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÄGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER SIG HÄRMEU UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET OCH LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÄL, AVSEENDE VARJE MSCI-INDEX OCH ALLA DATA SOM INGÄR I DEM. UTAN ATT DETTA PÄVERKAR NÄGOT AV DET OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÄGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÄGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPEU FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÄDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI World Climate Change 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

MSCI World Climate Change CTB Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindexet"), som är representativt för marknaderna med stora och medelstora bolag i 23 utvecklade länder (per december 2020). Indexet syftar 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.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Indexet strävar efter att minska sin växthusgasintensitet med minst 30 % jämfört med moderindexet och är avsett att uppfylla målet att minska koldioxidutsläppen med 7 % jämfört med föregående år, 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).

MSCI World Climate Change CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXWOTBNE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI World Climate Change CTB Select Index

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 (marknadstillräde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "*Riskbeskrivningar*" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

| Andelsklass | Valuta | Minsta initiala investering* | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|-------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
|             |        |                              | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| AE          | EUR    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,37 %            | 0,13 %               |
| IE          | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB ("Delfonden") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄ 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FASTSTÄLLANDE 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 PÄLITLIGA 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÄDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB

## 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

MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapperen för stora och medelstora bolag på utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index 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, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe ESG Broad CTB SELECT Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUEBSL

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehå 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Valuta           | Förvaltning                           |
| Derivat          | Marknad                               |
| Aktieexponering  | Hållbara investeringar                |
| Indexreplikering | Användning av tekniker och instrument |
| Investeringsfond |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utförd för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPE FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB

## 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

MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets Index ("överordnat index"), som motsvarar marknader för stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021). Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index 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, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMEBSL

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 2 %. 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 innehålla positioner 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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-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 HÄRMEDE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EMU 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

MSCI EMU ESG Broad CTB Select Net Total Return Index är ett aktieindex som är 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 vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. 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.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index 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, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMUEBL

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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".

Plan d'Epargne en Actions (PEA): Berättigad

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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

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

Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  |                 |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                     |            |
|---------------------|------------|
| Riskhanteringsmetod | Engagemang |
|---------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 UNDERFÖRSTÄTT, 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB

## 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

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Small Cap Index ("överordnat index"), representativt värdepapper för små bolag på utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. 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.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka MSCI 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, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEUSCCT

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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

Fonden 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 |
| Standard |                 |

**Riskhanteringsmetod** Engagemang

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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 %     | 0,25 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRANSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB

## 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

MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Pacific Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapperen för stora och medelstora bolag på fem utvecklade marknader i Stillahavsområdet. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index 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, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXPCCTNU

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "*Riskbeskrivningar*" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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 %     | 0,35 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB ("Delfonden") SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI World Climate Change Paris Aligned 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

MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindexet"), som är representativt för marknaderna med stora och medelstora bolag i 23 utvecklade länder (per mars 2020). Indexet syftar till att representera resultatet för en strategi som viktat om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU-referensvärdet för anpassning till Parisavtalet.

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

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Indexet strävar efter att minska sin växthusgasintensitet med minst 50 % jämfört med moderindexet och är avsett att uppfylla målet att minska koldioxidutsläppen med 7 % jämfört med föregående år, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXWOPALI

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI World Climate Change Paris Aligned Select 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### 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 innehålla 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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          | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÅENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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, SÄTTES 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 FRÄNSÄGER 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI EURO CORP 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

iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för investment grade-obligationer denominerade i euro, obligationer med fast ränta som emitterats av privata bolag (så kallade företagsobligationer) med återstående löptid mellan en månad och ett år och som tillämpar ytterligare sektor- och ESG-kriterier för valbarhet av värdepapper.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 Y TCA Index omfattar företagsobligationer med följande godtagbarhetskriterier:

- värdepapper 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.

Värdet för iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: IBXEEC1

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid). Vid indexberäkningen används mittkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Markit-index finns på [markit.com](http://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING 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 |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index ("indexet") som nämns här tillhör Markit Indices Limited. ("indexspansom") och har licensierats för användning i anknytning till AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG. Vardera part bekräftar och är överens om att AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexspansom. Indexspansom 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. Indexspansom 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.

Indexspansom gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG, om indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat, eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill, eller om risktagning i samband med det. Indexspansom har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG har, i likhet med indexspansom, något ansvar gentemot någon part för indexspansomns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexspansom och dess närstående företag får bedriva handel 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 AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral 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

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 kreditbetyget investment grade och som följer reglerna för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Index ("överordnat index") och använder sektor- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

I det tillämpliga området ingår alla värdepapper som ingår i det överordnade indexet (dvs. obligationer med fast ränta på investment grade i lokala valutor, inklusive statspapper, statliga relaterade emittenter och företagsemittenter, med en minsta emissionsstorlek på motsvarande 500 miljoner USD). 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.

Värdet för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I36446US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkurrsättning.

### 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING 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                                | Replikering av samplingsindex         |
| Säkringsrisk (säkrad andelsklass)                | Hållbara investeringar                |
| Indexreplikering                                 | Användning av tekniker och instrument |
| Räntesats                                        |                                       |
| Landrisk – Kina                                  |                                       |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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 - EUR HEDGED | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI GLOBAL AGG SRI eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL AGG SRI i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL AGG SRI. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI GLOBAL AGG SRI när Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av timing, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL AGG SRI. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI GLOBAL AGG SRI, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL AGG SRI.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI GLOBAL AGG SRI ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER DATA DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL AGG SRI ELLER BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRAV.

# AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral 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

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.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. obligationer med fast ränta och höga kreditbetyg på marknader i lokal valuta, inklusive statspapper, statsrelaterade emittenter och företagsemittenter, med en återstående löptid på mellan 1 och 5 år och en minsta emissionsstorlek på motsvarande 500 miljoner US-dollar). 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.

Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I36756US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Investeringsfond                      |
| Valuta                                           | Förvaltning                           |
| Derivat                                          | Marknad                               |
| Tillväxtmarknader                                | Replikering av samplingsindex         |
| Säkringsrisk (säkrad andelsklass)                | Hållbara investeringar                |
| Indexreplikering                                 | Användning av tekniker och instrument |
| Räntesats                                        |                                       |
| Landrisk – Kina                                  |                                       |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| Standard                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 – CHF HEDGED    | CHF    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,06 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR - HEDGED EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,06 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR – USD        | USD    | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral Index är servicemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5 eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5 i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5 när Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED 1-5 YEAR SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA, OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5 ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED 1-5 YEAR SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER DATA DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED 1-5 YEAR SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER DATA DÄR. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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 SKADOR – VARE SIG DIREKTA, INDIREKTA, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5 ELLER BLOOMBERG MSCI GLOBAL AGGREGATE 500MM EX SECURITIZED 1-5 YEAR SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM RISKEN FÖR DETTA HAR MEDDELATS.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year 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

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. Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I36068US

Indexets resultat som fastställs vid stängningstid på de lokala marknader som utgör indexet. Vid indexberäkningen används köpkurser. Den inledande kursen för nya företagsemissioner som tas med i indexet är säljkursen.

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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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:** US-dollar

### 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                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,25 %            | 0,10 %               |
| IE                     | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF - HEDGED GBP | GBP    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,09 %            | 0,06 %               |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y när Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i MUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI 1-5 YEAR INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI 1-5 YEAR INDEX ELLER DATA DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI 1-5 YEAR INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y ELLER BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI 1-5 YEAR INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRAV.



# AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI 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

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 ("överordnat index") och använder sektorkriterier och ytterligare miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35570EU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid). Vid indexberäkningen används köpkurser. Den inledande kursen för nya företagsemissioner som tas med i indexet är säljkursen. Efter den första månaden används köpkursen.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](http://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningssvappar 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,20 %            | 0,15 %               |
| IE             | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,05 %               |
| UCITS ETF DR   | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,04 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF 2 DR | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI när Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER DATA DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI YEAR INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI ELLER BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRÅV.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral 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

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 ("överordnat index") och använder sektorkriterier, miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 värdepappersiseringsemissioner). 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.

Värdet för Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35394EU

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 positioner 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,06 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI INDEX EURO AGG SRI eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI INDEX EURO AGG SRI i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI INDEX EURO AGG SRL. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI INDEX EURO AGG SRL när Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI INDEX EURO AGG SRI. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI INDEX EURO AGG SRI, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI INDEX EURO AGG SRI.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI EURO AGGREGATE SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI EURO AGGREGATE SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER DATA DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI EURO AGGREGATE SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI INDEX EURO AGG SRI ELLER BLOOMBERG MSCI EURO AGGREGATE SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRAV.

# AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year 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

Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index är ett obligationsindex som motsvarar obligationer som är noterade i euro med höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index ("överordnat index"), med återstående löptid på 0 eller 3 år som använder ytterligare sektorkriterier, miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I34717EU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid). Vid indexberäkningen används köpkurser. Den inledande kursen för nya företagsemissioner som tas med i indexet är säljkursen. Efter den första månaden används köpkursen.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 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                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser behålla sin investering i minst 18 månader.

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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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    | 500 000 USD                  | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närliggande företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och av Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y när Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i MUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG BBB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA, OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG BBB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR INDEX ELLER DATA DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEJ UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG BBB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR INDEX ELLER DATA DÄR. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y ELLER BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE ESG BBB+ SUSTAINABILITY SRI 0-3 YEAR INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRÅV.



## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI 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

Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som motsvarar företagsvärdepapper som är noterade i USD med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index ("överordnat index") och använder sektorkriterier och ytterligare miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index 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. Den inledande kursen för nya emissioner som tas med i indexet är säljkursen. Efter den första månaden används köpkursen.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,25 %            | 0,10 %               |
| IE           | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,05 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR | USD    | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närliggande företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI INDEX US CORP SRI eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI INDEX US CORP SRI i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI INDEX US CORP SRI. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI INDEX US CORP SRI när Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI INDEX US CORP SRI. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI INDEX US CORP SRI, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI INDEX US CORP SRI.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI INDEX US CORP SRI ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI US CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER DATA DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEJ UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI INDEX US CORP SRI ELLER BLOOMBERG MSCI US CORPORATE ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRAV.

Mål och placeringsinriktning

Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral 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

Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index följer skuldförbindelser med fast ränta, höga kreditbetyg och ett utestående nominellt belopp på minst 500 miljoner US-dollar. Detta index är baserat på US Aggregate ex Securitized 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 eftersom de är oförenliga med vissa värderingsbaserade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg. Dessutom viktas marknaden för de tre sektorerna (stater, statsrelaterat och företag) om för att stämma överens med vikterna för dessa tre sektorer i US Aggregate ex Securitized Index.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index inkluderar prioriterade och efterställda statsobligationer, statsrelaterade obligationer och företagsobligationer med minst ett års återstående löptid, oavsett optionalitet. Dessutom måste kapital och ränta vara denominerade i US-dollar med ett lägsta utestående nominellt belopp på 500 miljoner US-dollar.

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.

Värdet för Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37163US

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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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: 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,06 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF - EUR HEDGED | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index är servicemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI US AGG SRI eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI US AGG SRI i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och servicemärken och Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI US AGG SRI. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI US AGG SRI när Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av timing, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI US AGG SRI. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI US AGG SRI, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI US AGG SRI.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI US AGGREGATE EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI US AGG SRI ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI US AGGREGATE EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI US AGGREGATE EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX 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 SKADOR – VARE SIG DIREKTA, INDIREKTA, EFTERFÖLJANDE, TILFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL AGG SRI ELLER BLOOMBERG MSCI US AGGREGATE EX SECURITIZED SUSTAINABLE SRI SECTOR NEUTRAL INDEX 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 0-3Y SRI

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI 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

Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som är representativt för företagsobligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index ("moderindexet") med en återstående löptid på mellan en månad och tre år i slutet av varje månad och tillämpar ytterligare löptids- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i moderindexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar 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 US-dollar. Obligationer tas med i indexet på grundval av noteringsvalutan, inte emittentens riskland. 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.

Värdet för Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37481US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

## 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                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,03 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index är servicemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närliggande företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och servicemärken och Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI när Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 0-3 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 0-3 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 0-3 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 SKADOR – VARE SIG DIREKTA, INDIREKTA, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI ELLER BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 0-3 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 NET ZERO AMBITION PAB

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EMU Climate Paris Aligned 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

MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered 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. Indexet innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformade för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

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

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered Index 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMUPNE

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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".

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 1 %. Avkastningen, som används för att beräkna delfondens aktiva risk, fastställs innan hänsyn tas till någon mekanism för swingkursättning.

### 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 innehålla 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

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,08 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF   | EUR    | 1 000 000 euro               | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMU CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄ 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 PÄLITLIGA 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÅNSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.



# AMUNDI CHINA CNY BONDS<sup>(1)</sup>

## 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

Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index 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
- Indexsammansättning

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.

Värdet på Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I32561US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](http://bloomberg.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 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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla positioner 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**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                                | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| Räntesats                                        | Användning av tekniker och instrument |
| Landrisk – Kina                                  |                                       |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närliggande företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI CHINA CNY BONDS eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI CHINA CNY BONDS i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI CHINA CNY BONDS. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI CHINA CNY BONDS när Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av timing, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI CHINA CNY BONDS. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI CHINA CNY BONDS, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI CHINA CNY BONDS.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG CHINA TREASURY + POLICY BANK INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA, OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI CHINA CNY BONDS ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG CHINA TREASURY + POLICY BANK INDEX ELLER DATA DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSMÖRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG CHINA TREASURY + POLICY BANK INDEX ELLER DATA DÄR. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI CHINA CNY BONDS ELLER BLOOMBERG CHINA TREASURY + POLICY BANK INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRAV.

# AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI 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

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.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37162EU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.15 (Londontid). Vid indexberäkningen används köpkurser. Den inledande kursen för nya företagsemissioner som tas med i indexet är säljkursen. Efter den första månaden används köpkursen.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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

## 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 |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 %     | 0,25 %            | 0,10 %               |
| IE          | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF   | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index är servicemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och servicemärken och Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG när Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE 1-5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE 1-5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE 1-5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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 SKADOR – VARE SIG DIREKTA, INDIREKTA, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG ELLER BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE 1-5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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.

## 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

Bloomberg Global Aggregate Index 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
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg Global Aggregate Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: LEGATRUU

Vid indexberäkningen används köpkurser. För statsobligationer noterade i euro och brittiska pund används mittkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Valuta                                           | Marknad                               |
| Derivat                                          | MBS/ABS/TBA                           |
| Indexreplikering                                 | Replikering av samplingsindex         |
| Räntesats                                        | Hållbarhet                            |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| AE                        | EUR    | –                            | 4,50 %                           | 1,00 %     | 0,25 %            | 0,10 %               |
| IE                        | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR              | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,03 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF DR - EUR HEDGED | EUR    | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg Global Aggregate är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg Global Corporate IG select Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND när Bloomberg Global Aggregate Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av timing, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND ELLER BLOOMBERG GLOBAL AGGREGATE INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.



# AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND<sup>(1)</sup>

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond Index mäter resultatet för marknaden för värdepapper som inflationsskyddas av det amerikanska finansministeriet.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Värdepapperen som utgör indexet är värdepapper som emitteras av den amerikanska regeringen, noterade i US-dollar och med kupong och kapitalbelopp i US-dollar. Obligationer måste kapitalindexeras och kopplas till ett inhemskt inflationsindex. Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond Index är en delmängd till flaggskeppet Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond (WGILB) Index. US TIPS utgör den största komponenten i Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index. Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond Index innehåller det totala utestående beloppet för varje TIPS och justeras inte för belopp som hålls på kontot Federal Reserve System Open Market (SOMA) Account. Emissionens storlek måste vara lika med eller överstigande 500 miljoner US-dollar och obligationerna måste ha en minsta återstående livslängd på minst ett år.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Värdet för Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond Index tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: BCIT1T

Indexets resultat som fastställs vid stängningstid på de lokala marknader som utgör indexet. Vid indexberäkningen används marknadens mittkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på bloomberg.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 obligationer kopplade till inflationen och som är representativa för indexets beståndsdelar i en proportion som ligger extremt nära deras proportion 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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,25 %            | 0,10 %               |
| IE                 | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR – USD | USD    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,03 %            | 0,06 %               |

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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närtstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND när Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI US GOV INFLATION-LINKED BOND. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI US GOV INFLATION-LINKED BOND, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI US GOV INFLATION-LINKED BOND.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG CAPITAL US GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA, OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG CAPITAL US GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ELLER DATA DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSGOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG CAPITAL US GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ELLER DATA DÄR. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND ELLER BLOOMBERG CAPITAL US GOVERNMENT INFLATION-LINKED BOND INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRÅV.

# AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG

(omformas per den 19.04.2024)

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för J.P. MORGAN GBI EMU Investment Grade Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

J.P. MORGAN GBI EMU Investment Grade Index är ett obligationsindex, som är representativt för inhemska statsobligationer som är emitterade av länder i euroområdet och som har ett högt kreditbetyg från vart och ett av de tre kreditvärderingsinstituten (Standard & Poors, Fitch och Moodys).

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Indexet omfattar endast likvida obligationer med fast kupong utgivna av stater där euron är den officiella valutan.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av J.P. Morgan.

Värdet för J.P. MORGAN GBI EMU Investment Grade Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: JPEIEMUI

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i J.P. Morgan-indexet finns på [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.

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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Valuta                                           | Marknad                               |
| Derivat                                          | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,20 %            | 0,15 %               |
| IE          | EUR    | 500 000 USD                  | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Copyright 2017 JPMorgan Chase & Co. Med ensamrätt. J.P. Morgan är marknadsföringsnamnet för JPMorgan Chase & Co. och dess dotterbolag och närstående företag över hela världen. J.P. Morgan Securities Inc. är medlem i NYSE och SIPC. JPMorgan Chase Bank, National Association är medlem i FDIC. J.P. Morgan Futures Inc. är medlem i NFA. J.P. Morgan Securities Ltd. och J.P. Morgan plc är auktoriserade av FSA och medlemmar i LSE. J.P. Morgan Europe Limited är auktoriserat av FSA. J.P. Morgan Equities Limited är medlem i Johannesburg Securities Exchange och regleras av FSB. J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited är registrerad som investeringsrådgivare hos Securities & Futures Commission i Hongkong och dess CE-nummer är AAJ321. J.P. Morgan Securities Singapore Private Limited är medlem i Singapore Exchange Securities Trading Limited och regleras av Monetary Authority of Singapore ("MAS"). J.P. Morgan Securities Asia Private Limited regleras av MAS och Financial Services Agency i Japan. J.P. Morgan Australia Limited (ABN 52 002 888 011) är en licensierad återförsäljare av värdepapper.

AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av J.P. Morgan. J.P. Morgan lämnar inga utfästelser eller garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG eller till någon i allmänheten avseende lämpligheten i att investera i värdepapper i allmänhet, eller i AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG i synnerhet, eller förmågan hos J.P. MORGAN GBI EMU Investment Grade för att följa resultaten på obligationsmarknaden i allmänhet. J.P. Morgans enda förhållande till Amundi Asset Management är licensiering av J.P. MORGAN GBI EMU Investment Grade som fastställs, sätts samman och beräknas av J.P. Morgan utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG. J.P. Morgan har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG när J.P. MORGAN GBI EMU Investment Grade fastställs, sätts samman eller beräknas. J.P. Morgan varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG eller i fastställandet eller beräkningen av den ekvation genom vilken AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG ska omvandlas till likvida medel. J.P. Morgan har ingen skyldigheter och inget ansvar i samband med administration, marknadsföring eller handel i AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG.

J.P. Morgan OCH AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG ÄR TILLGÄNGLIGA I "BEFINTLIGT SKICK" OCH MED EVENTUELLA FEL. J.P. Morgan GARANTERAR INTE TILLGÄNGLIGHETEN, ORDNINGEN, AKTUALITETEN, KVALITETEN, NOGGRANNHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN I J.P. Morgan ELLER AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG ELLER DATA SOM INGÅR DÄRI, ELLER SOM PÅ ANNAT SÄTT ERHÅLLITS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG, ELLER AV NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET, FRÅN NÅGON ANVÄNDNING AV J.P. Morgan ELLER AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG. J.P. Morgan LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRANSÄGER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNING MED AVSEENDE PÅ J.P. Morgan ELLER NÅGON DATA DÄRI, ELLER SOM PÅ ANNAT SÄTT ERHÅLLITS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG, ELLER AV NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET, FRÅN NÅGON ANVÄNDNING AV J.P. Morgan ELLER AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG. DET FINNS INGA UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER SOM STRÄCKER SIG LÄNGRE ÄN BESKRIVNINGEN ENLIGT DETTA DOKUMENT, OM NÅGRA. ALLA GARANTIER OCH UTFÄSTELSER AV NÅGOT SLAG MED AVSEENDE PÅ J.P. Morgan ELLER AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG, FRISKRIVER SIG FRÅN ALLA UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OM SÄLJBARHET, KVALITET, NOGGRANNHET, LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER MOT INTRÄNG ELLER GARANTIER FÖR EVENTUELLA RESULTAT SOM KAN UPPNÅS GENOM ELLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV J.P. Morgan ELLER ANVÄNDNINGEN ELLER KÖPET AV AMUNDI INDEX J.P. MORGAN EMU GOVIES IG. UTAN ATT BEGRÄNSA NÅGOT AV DET FÖREGÅENDE HAR J.P. MORGAN UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SPECIELLA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, DIREKTA, INDIREKTA ELLER PÅFÖLJANDE SKADOR, INKLUSIVE FÖRLUST AV KAPITAL OCH/ELLER FÖRLORAD VINST, ÄVEN OM MEDDELANDE OM MÖJLIGHETEN TILL SÅDANA SKADOR SKER.

# AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND<sup>(1)</sup>

(gäller från den 19.04.2024)

## 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

Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn Bond Index 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
- Indexsammansättning

Indexet uppfyller följande kriterier: [Br]– Endast statsobligationer ingår i indexet [br]– Godtagbara obligationer har ett utestående nominellt belopp på minst 300 miljoner euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro. Förteckningen över länder som får tas med i indexet ses över årligen. [br]– 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. [br]– Den återstående löptiden måste vara minst ett år till den slutliga förfallodagen, oavsett optionalitet. [br]– Kapital och ränta måste vara denominerade i euro.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Bloombergs officiella index beräknas av Bloomberg utifrån:

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

Värdet för Bloomberg Euro Treasury 50bn Bond Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35205EU

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 Bloomberg-indexet finns på bloomberg.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 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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 positioner 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Valuta                                           | Marknad                               |
| Derivat                                          | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,20 %            | 0,15 %               |
| IE             | EUR    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,05 %               |
| UCITS ETF ACC  | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,04 %            | 0,10 %               |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg Euro Treasury 50bn Bond Index är tjänstemärken tillhörande 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 AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg Euro Treasury 50bn Bond Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND när Bloomberg Euro Treasury 50bn Bond Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning till kunder till AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN BOND INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄRL. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN BOND INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN BOND INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND ELLER BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN BOND INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för J.P. Morgan Government Bond Index Global (GBI Global) ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

J.P. Morgan Global Government Bond Index (GBI Global) 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
- Indexsammansättning

Värdepapperen som ingår i indexet är statspapper med fast ränta som emitteras 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.

Värdet för J.P. Morgan Government Bond Index Global (GBI Global) 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 [jpmorgan.com](http://jpmorgan.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 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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Valuta                                           | Marknad                               |
| Derivat                                          | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| Räntesats                                        | Användning av tekniker och instrument |
| Investeringsfond                                 |                                       |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| AHE                       | EUR    | –                            | 3,50 %                           | 1,00 %     | 0,20 %            | 0,15 %               |
| IE                        | EUR    | 500 000 USD                  | 1,50 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR              | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,10 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR - EUR HEDGED | EUR    | 1 000 000 USD                | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI ASSET MANAGEMENT'S AMUNDI INDEX J.P. MORGAN GBI GLOBAL GOVIES SPONSORAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV J.P. MORGAN OCH J.P. MORGAN GÖR INGA UTFÅSTELSER OM HURUVIDA DET ÄR LÄMPLIGT ATT INVESTERA I AMUNDIS AMUNDI INDEX J.P. MORGAN GBI GLOBALA GOVIES. J.P. MORGAN GARANTERAR INTE FULLSTÄNDIGHETEN ELLER KORREKTHETEN I J.P. MORGAN GOVERNMENT BOND INDEX GLOBAL (GBI GLOBAL). "J.P. MORGAN" ÄR REGISTRERAT TJÄNSTEMÄRKE TILLHÖRANDE JPMORGAN CHASE & CO. © 2016. JPMORGAN CHASE & CO. MED ENSAMRÄTT.



## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA 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

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 företagsemitter som följer reglerna i iBoxx EUR High Yield TCA Index ("moderindexet") och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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.
- 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.

Värdet för iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXLHYT

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-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 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 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

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Kredit           | Förvaltning                           |
| Derivat          | Marknad                               |
| Hög avkastning   | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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 Acc  | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,33 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF DR 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA ("indexet") som nämns här tillhör Markit Indices Limited. ("indexspansom") och har licensierats för användning i anknytning till AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG. Vardera part bekräftar och är överens om att AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexspansom. Indexspansom 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. Indexspansom 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.

Indexspansom gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG, om indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat, eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill, eller om risktagning i samband med det. Indexspansom har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG har, i likhet med indexspansom, något ansvar gentemot någon part för indexspansomns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexspansom och dess närstående företag får bedriva handel 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 AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG."

# AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Boxx 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

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 företagsemitter som följer reglerna för iBoxx EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index ("moderindexet") och tillämpar ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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.

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.

Värdet för iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index 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 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 positioner 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Derivat                                          | Marknad                               |
| Hög avkastning                                   | 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 |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | 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

Delfonden kan tilltala investerare som vill replikera indexets resultat

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

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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    | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates 1-3 TCA Index ("indexet") som nämns här tillhör Markit Indices Limited. ("indexspansom") och har licensierats för användning i anknytning till AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG. Vardera part bekräftar och är överens om att AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexspansom. Indexspansom 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. Indexspansom ska inte hållas ansvarig (vare sig på grund av oaksamhet 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.

Indexspansom gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG, 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. Indexspansom har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG eller indexspansom har något ansvar gentemot någon part för indexspansomns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexspansom 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 AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG.

# 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 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

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.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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.

Värdet för iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXFRNT

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-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 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 (marknadstillräde, 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

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Kredit           | Förvaltning                           |
| Derivat          | Marknad                               |
| Indexreplikering | Replikering av samplingsindex         |
| Räntesats        | Hållbara investeringar                |
| Investeringsfond | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,11 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF GBP HEDGED | GBP    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,13 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF USD HEDGED | USD    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,13 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF MXN HEDGED | MXN    | 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](https://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 här till tillhör Markit Indices Limited. ("indexspansom") och har licensierats för användning i anknytning till AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG. Vardera part bekräftar och är överens om att AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexspansom. Indexspansom 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. Indexspansom 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.

Indexspansom gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG, om indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat, eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill, eller om risktagning i samband med det. Indexspansom har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG har, i likhet med indexspansom, något ansvar gentemot någon part för indexspansomns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexspansom och dess närstående företag får bedriva handel 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 AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG.



# 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 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

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.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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 mätt 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.

Värdet för iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index finns 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 [markit.com](http://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 innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | Tillåtet                  |

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

| Andelsklass          | Valuta | Minsta initiala investering* | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|----------------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
|                      |        |                              | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| UCITS ETF            | USD    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,11 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF EUR HEDGED | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,13 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF MXN HEDGED | MXN    | 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](https://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 här till tillhör Markit Indices Limited. ("indexspansom") och har licensierats för användning i anknytning till AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG. Vardera part bekräftar och är överens om att MUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexspansom.

Indexspansom 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. Indexspansom 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.

Indexspansom gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG, om indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat, eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill, eller om risktagning i samband med det. Indexspansom har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG har, i likhet med indexspansom, något ansvar gentemot någon part för indexspansomns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexspansom och dess närstående företag får bedriva handel 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 AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG.

# AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable 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.

Detta index är baserat på Bloomberg Global High Yield Corporate 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 fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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. Den inledande kursen för nya företagsemissioner som tas med i indexet är säljkursen. Efter den första månaden används köpkursen.

Värdet för Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index 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 [bloomberg.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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: US-dollar

Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

Risker vid normala marknadsförhållanden

|                                                  |                            |
|--------------------------------------------------|----------------------------|
| Kredit                                           | Investeringsfond           |
| Valuta                                           | Förvaltning                |
| Derivat                                          | Marknad                    |
| Säkringsrisk                                     | (säkradReplikering av      |
| andelsklass)                                     | samlingsindex              |
| Hög avkastning                                   | Hållbara investeringar     |
| Indexreplikering                                 | Användning av tekniker och |
| Räntesats                                        | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 CET

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 - HEDGED EUR | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,20 %            | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närliggande 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 AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG när Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning till kunder till AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG ELLER BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.

# AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Markit iBoxx USD Liquid Emerging Markets Sovereigns Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Markit iBoxx USD Liquid Emerging Markets Sovereigns Index är ett obligationsindex som representerar obligationer i US-dollar utgivna av regeringar eller centralbanker i tillväxtländer.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Markit iBoxx USD Liquid Emerging Markets Sovereigns Index omfattar obligationer med följande kvalificeringskrav:

- obligationer utfärdade i US-dollar med fasta kuponger eller med en "stegklausul" (möjlighet att ändra kupongräntan under obligationens löptid, enligt villkor som fastställs särskilt för varje obligation)
- emitterade till ett totalbelopp på minst 500 miljoner US-dollar
- löptid över 2 år när de tas med i indexet (1,25 år för obligationer som redan ingår i indexet)
- obligationer vars kreditbetyg är minst CCC från Fitch, Moodys och Standard and Poors
- emittenten ska inte ha betalningsinställelser på sina externa skulder och ska ha ett långsiktigt kreditbetyg från ett av följande kreditvärderingsinstitut: Fitch, Moodys eller Standard & Poors. Betalningsinställelse baseras på information som tillhandahålls av kreditvärderingsinstituten (Fitch, Moodys eller Standard & Poors), eller med betyget D eller RD för Fitch, C eller Ca för Moodys och D eller SD för S&P.

Alla länder representeras av minst två emissioner. Vikten för varje land beräknas med hänsyn till alla emissioner i US-dollar i det landet. Vikten för varje indexkomponent grundas på dess marknadsvärde.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Markit.

Värdet för Markit iBoxx USD Liquid Emerging Markets Sovereigns Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: IBXXLES1

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 Markit-index finns på [markit.com](http://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.

Delfonden innehar inga värdepapper i företag som verkar inom produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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:** 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    | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering  | Hållbarhet                            |
| Räntesats         | Användning av tekniker och instrument |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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 – USD | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Markit iBoxx USD Liquid Emerging Markets Sovereigns Index ("indexet") som nämns här tillhör Markit Indices Limited. ("indexspansom") och har licensierats för användning i anknytning till AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX. Vardera part bekräftar och är överens om att AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX inte sponsras, stöds eller marknadsförs av indexspansom. Indexspansom 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. Indexspansom 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.

Indexspansom gör inga som helst utfästelser, varken uttryckliga eller underförstådda, beträffande lämpligheten i att köpa eller sälja AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX, om indexets förmåga att följa relevanta marknadsresultat, eller som på annat sätt är relaterade till indexet eller transaktioner eller produkter med koppling därtill, eller om risktagning i samband med det. Indexspansom har ingen skyldighet att ta hänsyn till någon parts behov när indexet fastställs, sammanställs eller beräknas. Ingen part som köper eller säljer AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX har, i likhet med indexspansom, något ansvar gentemot någon part för indexspansomns handlingar eller underlåtenhet att handla i samband med indexets fastställande, justering, beräkning eller upprätthållande. Indexspansom och dess närstående företag får bedriva handel 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 AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX."



# AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT<sup>(1)</sup>

## 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

J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Years Tilted Index är ett obligationsindex som motsvarar inflationsindexerade statsobligationer som är noterade i lokal valuta med höga kreditbetyg som är emitterade på en av 12 olika utvecklade marknader – Australien, Kanada, Danmark, Frankrike, Tyskland, Italien, Japan, Spanien, Sverige, Storbritannien och USA –, som ger högre vikt till emittenter med högre JESG-betyg och lägre vikt till emittenter med lägre JESG-betyg.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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 J.P. Morgan ESG (JESG) emittentbetyg\* för att justera vikterna för indexets komponenter jämfört med respektive basindex. JESG-indexvärdet är en sammanslagning av Verisk Maplecroft och Sustainalytics på lika vikt. Betygen varierar från 0 – 100, där 100 är som bästa möjliga betyg.

JESG-betygen indelas i band som används för att skala varje emissions marknadsvärde för basindex. JESG-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 JESG-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 lutning baserad på JESG-betyg inte överstiga två gånger sin marknadsvärdesbaserade viktning. Viktningen ändras varje månad på varje ombalanseringsdag, och viktningen förblir aktiv under resten av den månaden.

\*Läs om indexmetoden på [jpmorgan.com](http://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.

Värdet för J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Year Tilted Index 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 [jpmorgan.com](http://jpmorgan.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 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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehåller inga värdepapper i företag som verkar inom produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 (marknadstillräde, likviditet och lokala skatter) kommer investeringsförvaltaren att kunna kombinera direkt replikering med en replikering genom derivat, bland annat terminer. Vid sådan replikering kan delfonden innehålla 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:** 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                                 | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| IU           | USD    | 500 000 USD                  | 2,50 %                           | 1,00 %     | 0,04 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DR | USD    | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Copyright 2017 JPMorgan Chase & Co. Med ensamrätt. J.P. Morgan är marknadsföringsnamnet för JPMorgan Chase & Co. och dess dotterbolag och närstående företag över hela världen. J.P. Morgan Securities Inc. är medlem i NYSE och SIPC. JPMorgan Chase Bank, National Association är medlem i FDIC. J.P. Morgan Futures Inc. är medlem i NFA. J.P. Morgan Securities Ltd. och J.P. Morgan plc är auktoriserade av FSA och medlemmar i LSE. J.P. Morgan Europe Limited är auktoriserat av FSA. J.P. Morgan Equities Limited är medlem i Johannesburg Securities Exchange och regleras av FSB. J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited är registrerad som investeringsrådgivare hos Securities & Futures Commission i Hongkong och dess CE-nummer är AAJ321. J.P. Morgan Securities Singapore Private Limited är medlem i Singapore Exchange Securities Trading Limited och regleras av Monetary Authority of Singapore ("MAS"). J.P. Morgan Securities Asia Private Limited regleras av MAS och Financial Services Agency i Japan. J.P. Morgan Australia Limited (ABN 52 002 888 011) är en licensierad återförsäljare av värdepapper.

AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT sponsras, stöds, säljs eller marknadsförs inte av J.P. Morgan. J.P. Morgan lämnar inga utfästelser eller garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, till ägarna av AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT eller till någon i allmänheten avseende lämpligheten i att investera i värdepapper i allmänhet, eller i AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT i synnerhet, eller förmågan hos J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Year Tilted Index för att följa resultaten på obligationsmarknaden i allmänhet. J.P. Morgans enda förhållande till Amundi Asset Management är licensiering av J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Year Tilted Index som fastställs, sätts samman och beräknas av J.P. Morgan utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED OBLIGATION SELECT. J.P. Morgan har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT när J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Year Tilted Index fastställs, sätts samman eller beräknas. J.P. Morgan varken ansvarar för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT eller i fastställandet eller beräkningen av den ekvation genom vilken AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT ska omvandlas till kontanter. J.P. Morgan har ingen skyldigheter och inget ansvar i samband med administration, marknadsföring eller handel i AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT.

J.P. Morgan AND AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT ÄR TILLGÄNGLIGA I BEFINTLIGT SKICK OCH MED EVENTUELLA FEL. J.P. Morgan GARANTERAR INTE TILLGÄNGLIGHETEN, ORDNINGEN, AKTUALITETEN, KVALITETEN, NOGGRANNHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN I J.P. MORGAN OCH/ELLER AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED OCH/ELLER DATA SOM INGÅR DÄRI, ELLER SOM PÅ ANNAT SÄTT ERHÅLLITS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT, ELLER AV NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET, FRÅN NÅGON ANVÄNDNING AV J.P. Morgan OCH/ELLER AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT. J.P. Morgan LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRÅNSÄGER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNING MED AVSEENDE PÅ J.P. Morgan ELLER NÅGON DATA DÄRI, ELLER SOM PÅ ANNAT SÄTT ERHÅLLITS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT, ELLER AV NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET, FRÅN NÅGON ANVÄNDNING AV J.P. Morgan OCH/ELLER AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT. DET FINNS INGA UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER SOM STRÄCKER SIG LÄNGRE ÄN BESKRIVNINGEN ENLIGT DETTA DOKUMENT, OM NÅGRA. ALLA GARANTIER OCH UTFÄSTELSER AV NÅGOT SLAG MED AVSEENDE PÅ J.P. Morgan OCH/ELLER AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT, FRISKRIVER SIG FRÅN ALLA UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OM SÄLJBARHET, KVALITET, NOGGRANNHET, LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL OCH/ELLER MOT INTRÄNG OCH/ELLER GARANTIER FÖR EVENTUELLA RESULTAT SOM KAN UPPNÅS GENOM OCH/ELLER FRÅN ANVÄNDNINGEN AV J.P. Morgan OCH/ELLER ANVÄNDNINGEN OCH/ELLER KÖPET AV AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT. UTAN ATT BEGRÄNSA NÅGOT AV DET FÖREGÅENDE HAR J.P. MORGAN UNDER INGA OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR NÅGRA SPECIELLA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE, DIREKTA, INDIREKTA ELLER PÅFÖLJANDE SKADOR, INKLUSIVE FÖRLUST AV KAPITAL OCH/ELLER FÖRLORAD VINST, ÄVEN OM MEDDELANDE OM MÖJLIGHETEN TILL SÅDANA SKADOR SKER.

# AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y<sup>(1)</sup>

## 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

Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index erbjuder exponering mot räntebärande offentliga obligationer med höga kreditbetyg emitterade av suveräna stater som deltar i Europeiska och monetära unionen. 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
- Indexsammansättning

Bloomberg Barclays Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index omfattar obligationer med följande urvalskriterier:

- Minsta utestående belopp på 300 miljoner euro (per den 31 maj 2022)
- 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
- Kapitalbelopp och ränta måste vara denominerade i euro

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Bloomberg.

Värdet för Bloomberg Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35202EU

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](http://bloomberg.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 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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehå 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Investeringsfond                      |
| Derivat                                          | Förvaltning                           |
| Säkringsrisk (såkrad andelsklass)                | Marknad                               |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| Räntesats                                        | Användning av tekniker och instrument |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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) |

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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index är tjänstemärken tillhörande 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 AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och av Bloomberg Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y när Bloomberg Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning till kunder till AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN 25+ YEAR BOND INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN 25+ YEAR BOND INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSGRÄNS OMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN 25+ YEAR BOND INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÅENDE, I DEN UTSTRÄCKNING SOM LAGEN TILLÅTER, SKA BLOOMBERG, DESS LICENSIVÄRDARE OCH DESS RESPEKTIVE ANSTÄLLDA, ENTREPRENÖRER, OMBUD OCH LEVERANTÖRER INTE HA NÅGOT SOM HELST ANSVAR FÖR NÅGON SKADA – VARE SIG DIREKT, INDIREKT, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIG, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y ELLER BLOOMBERG EURO TREASURY 50BN 25+ YEAR BOND INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.

# AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND<sup>(1)</sup>

## 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

Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index är baserat på Euro Treasury 50bn Bond Index ("överordnat index") och mäter resultatet för statliga skuldförbindelser med höga kreditbetyg och fast ränta, som är 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
- Indexsammansättning

Indexet uppfyller följande kriterier:

- Godtagbara obligationer har ett utestående nominellt belopp på minst 300 miljoner euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro. Förteckningen över länder som får tas med i indexet ses över årligen.
- 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.

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 mittkurser.

Värdet för Euro Treasury Green Bond Tilted Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37637EU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://www.bloomberg.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 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 på högst 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 positioner 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**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 |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

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

"Bloomberg®" och Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index är tjänstemärken tillhörande 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 AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND när Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG EURO TREASURY GREEN BOND TILTED INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG EURO TREASURY GREEN BOND TILTED INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG EURO TREASURY GREEN BOND TILTED INDEX 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, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND ELLER BLOOMBERG EURO TREASURY GREEN BOND TILTED INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.



# AMUNDI GOVT BOND HIGHEST RATED EURO INVESTMENT GRADE<sup>(1)</sup>

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index 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, Moodys och Fitch.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index 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 FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond 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

Vikten för varje indexkomponent grundas på dess marknadsvärde.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av FTSE ("FTSE").

Värdet för FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: EM3AG5

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](http://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 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 innehar inga värdepapper i företag som verkar inom produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| 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 |                 |

### Riskhanteringsmetod

Engagemang



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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 – EUR | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI GOVT BOND HIGHEST RATED EURO INVESTMENT GRADE SUB-FUND 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 UTFÅSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond INDEX ("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 GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE<sup>(1)</sup>

## 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

FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG Index 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
- Indexsammansättning

FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG Index omfattar obligationer med följande godtagbarhetskriterier:

- 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)
  - utfärdat av ett land 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 av ett av kreditvärderingsinstituten S&P, Moodys och Fitch
  - minst två höga kreditbetyg, också från kreditvärderingsinstituten S&P, Moodys och Fitch dvs större eller lika med BBB- hos S&P och Fitch och Baa3 hos Moodys
  - emitterade till ett totalbelopp om sammanlagt 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 %
- Vikten för varje indexkomponent grundas 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").

Värdet för FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: EMTSIG5

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](http://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 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 innehar inga värdepapper i företag som verkar inom produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 (marknadstillräde, 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

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| 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 |                 |

### Riskhanteringsmetod

Engagemang

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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 – EUR | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE SUB-FUND 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 UTFÅSTELE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG INDEX ("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 GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3<sup>(1)</sup>

## 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

FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG 1-3Y Index 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
- Indexsammansättning

FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG 1-3Y Index omfattar obligationer med följande godtagbarhetskriterier:

- 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)
  - utfärdat av ett land bland de euroländer som anges i indexleverantörens metod
  - löptid från 1 till 3 år
  - som 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
  - som även har minst två investment grade-kreditbetyg från S&P, Moody's och Fitch
  - emitterade till ett totalbelopp på minst 2 miljarder euro
  - emitterter som inte ingår i FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond 1-3Y Index
  - emitterter 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 %
- Vikten för varje indexkomponent grundas 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").

Värdet för FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG 1-3Y Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: EMTSIA5

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid). Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](http://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 innehar inga värdepapper i företag som verkar inom produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Kredit           | Förvaltning                           |
| Derivat          | Marknad                               |
| Indexreplikering | Hållbarhet                            |
| 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 behålla sin investering i minst 18 månader.

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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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** Tillåtet

## HUVUDSAKLIGA ANDELSKLASSER OCH AVGIFTER

| Andelsklass        | Valuta | Minsta initiala investering* | Avgifter för andelstransaktioner |            | Årsavgifter       |                      |
|--------------------|--------|------------------------------|----------------------------------|------------|-------------------|----------------------|
|                    |        |                              | Förvärv (max)                    | Byte (max) | Förvaltning (max) | Administration (max) |
| UCITS ETF DR – EUR | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3 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 UTFÅSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG 1-3Y INDEX ("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 ITALY BTP GOVERNMENT BOND 1-3Y<sup>(1)</sup>

## 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
- Indexsammansättning

Jämförelseindexet 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").

Värdet för FTSE Eurozone Italy Government 1-3Y (Mid Price) Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: FMMPITA5

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](https://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 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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehå 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 "Replikeringstekniker" 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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 DIST | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 1-3Y SPONSRRAS, 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 UNDERFÖRSTÅTT, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Eurozone Italy Government 1-3Y (Mid Price) Index ("INDEXET") OCH/ELLER DEN SIFFRA VID VILKEN DETTA INDEX STÅR VID EN VISS TID ELLER DAG ELLER PÅ ANNAT SÄTT. INDEXET SAMMANSTÄLLS OCH BERÄKNAS AV FTSE. INGEN AV LICENSGIVARPARTERNA SKA HÄLLAS 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<sup>(1)</sup>

## 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

Jämförelseindexet 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
- Indexsammansättning

Jämförelseindexet 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").

FTSE Eurozone Target Maturity Government Bond Italy (Mid Price) Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: FMMPITX5

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](https://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 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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehå 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 "Replikeringstekniker" 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 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 |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 15:30 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 | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 10Y 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 UNDERFÖRSTÅTT, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Eurozone Target Maturity Government Bond Italy (Mid Price) Index ("INDEXET") OCH/ELLER DEN SIFFRA VID VILKEN DETTA INDEX STÅR 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 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

Bloomberg euro Corporate Bond Index är ett brett jämförelseindex som mäter marknaden för företagsobligationer som har höga kreditbetyg, är noterade i euro med fast ränta. 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
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg Euro Corporate Bond Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: LECPTREU

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid).

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](http://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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Valuta                                           | Marknad                               |
| Derivat                                          | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| Räntesats                                        | Användning av tekniker och instrument |
| Investeringsfond                                 |                                       |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,05 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg Euro Corporate Bond Index är tjänstemärken tillhörande 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 AMUNDI EUR CORPORATE BOND eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI EUR CORPORATE BOND i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg Euro Corporate Bond Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI EUR CORPORATE BOND. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI EUR CORPORATE BOND när Bloomberg Euro Corporate Bond Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av timing, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI EUR CORPORATE BOND. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI EUR CORPORATE BOND, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI EUR CORPORATE BOND.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI EUR CORPORATE BOND ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX 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, TILFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI EUR CORPORATE BOND ELLER BLOOMBERG EURO CORPORATE BOND INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.

# AMUNDI PRIME EURO GOV BONDS 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

Solactive Eurozone Government Bond 0-1 Year Index 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
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Solactive Eurozone Government Bond 0-1 Year Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLEUS01

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid).

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 [solactive.de](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla 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

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Kredit           | Marknad                               |
| Indexreplikering | Replikering av samplingsindex         |
| Räntesats        | Hållbarhet                            |
| Investeringsfond | Användning av tekniker och instrument |
| Förvaltning      |                                       |

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| Standard                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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    | 500 000 USD                  | 3,50 %                           | 1,00 %     | 0,03 %            | 0,02 %               |
| 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](https://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 REPRÉSENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.



## 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

Solactive Eurozone Government Bond Index 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 Moodys).

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 Moodys), dvs. obligationernas betyg måste vara lika med eller högre än BBB- för Standard & Poors eller Baa3 för Moodys.

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.

Värdet för Solactive Eurozone Government Bond Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLEUSOV

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 17.15 (Paris-tid).

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://solactive.de)

(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 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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Valuta                                           | Marknad                               |
| Derivat                                          | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 %     | 0,03 %            | 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](https://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<sup>(1)</sup>

## 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

Solactive Global Developed Government Bond Index 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
- Indexsammansättning

För att inkluderas i indexet måste landet ha ett högt kreditbetyg från ett kreditvärderingsinstitut (Standard & Poors eller Moodys), dvs. kreditbetyget för landets obligationer måste vara lika med eller högre än BBB- för Standard & Poors eller Baa3 för Moodys, 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 av 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.

Värdet för Solactive Global Developed Government Bond Index finns 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.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://solactive.de)

(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 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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Förvaltning                           |
| Valuta                                           | Marknad                               |
| Derivat                                          | Replikering av samplingsindex         |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet                            |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| 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](http://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.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Solactive USD Investment Grade Corporate Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Solactive USD Investment Grade Corporate Index är ett obligationsindex som är representativt för kreditvärdiga USD-denominerade företagsvärdepapper med fast ränta.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Värdepapperen som ingår i indexet har goda kreditbetyg av Moody's eller S&P och har minst ett års återstående löptid. Det lägsta utestående beloppet per emission är 400 miljoner US-dollar. Både högre och lägre prioriterade emissioner ingår.

Beståndsdelarna tas med i indexet baserat på emissionens valuta och inte emittentens hemvist.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Värdet på Solactive USD Investment Grade Corporate Index tillhandahålls via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLUSIGC

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 15.00 (New York-tid).

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](https://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.

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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**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                            |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 | 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](https://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.

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Solactive US Treasury Bond Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Solactive US Treasury Bond Index är ett obligationsindex som är representativt för värdepapper noterade i US-dollar, utgivna av USA:s finansdepartement och med löptider på minst 1 år.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar

- Indexsammansättning

Solactive US Treasury Bond Index innehåller obligationer med följande kvalificeringskriterier:

- utfärdade av det amerikanska finansdepartementet
- obligationer i US-dollar med fast kupong
- emitterade till ett totalbelopp på minst 250 miljoner US-dollar.

Vikten för varje indexkomponent grundas på dess marknadsvärde.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske månadsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Värdet för Solactive US Treasury Bond Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOLUTC

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 15.00 (New York-tid).

Vid indexberäkningen används köpkurser.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://solactive.de)

(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.

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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

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

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|          |                 |
|----------|-----------------|
| Motpart  | Likviditet      |
| Operativ | Standardmetoder |
| Standard |                 |

|                            |            |
|----------------------------|------------|
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang |
|----------------------------|------------|



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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 | 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](https://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 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

Bloomberg US Short Treasury Index 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
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg US Short Treasury Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: LT12TRUU

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 positioner 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:** 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                            |
| Räntesats                                        | Användning av tekniker och instrument |
| Investeringsfond                                 |                                       |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| Standard                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,03 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg US Short Treasury Index är tjänstemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och servicemärken och Bloomberg BioEnergy ESG Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y när Bloomberg US Short Treasury Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG US SHORT TREASURY INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG US SHORT TREASURY INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG US SHORT TREASURY INDEX 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 SKADOR – VARE SIG DIREKTA, INDIREKTA, EFTERFÖLJANDE, TILLFÄLLIGA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y ELLER BLOOMBERG BIOENERGY ESG INDEX 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 SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för SHORTDAX Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Indexet, som beräknas av STOXX Ltd., är knutet till resultatet för det tyska indexet för ledande storföretag DAX® (Performance Index) ("basindexet") och följer på indexnivå resultatet för en investering med en kort position i förhållande till DAX® Index.

DAX® Index som beräknas av STOXX Ltd. omfattar de 40 största tyska företagen med högst omsättning som är noterade på Frankfurtbörsen.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Indexet, som beräknas av STOXX Ltd., är knutet till resultatet för det tyska indexet för ledande storföretag DAX® (Performance Index) ("basindexet") och följer på indexnivå resultatet för en investering med en kort position i förhållande till DAX® Index.

Resultatet för ShortDAX® TR Index, som fastställs dagligen, motsvarar ungefär det omvända resultatet för basindexet. En positiv förändring i basindexet resulterar i en negativ förändring och en negativ förändring i basindexet resulterar i en positiv förändring av liknande omfattning i procent dagligen i indexet.

Utöver det omvända DAX®-resultatet innehåller indexet även räntebetalningar som är en följd av investeringsstrategin på dubbelt så mycket som den korta euroräntan ("€STR"). Den upplupna räntan är dubbelt så stor för investeringsvolymen och för de medel som erhålls från blankning. Dessutom beaktas de utlåningskostnader som uppstår i samband med befintliga korta positioner vid beräkningen av indexet.

Den korta euroräntan (€STR) återspeglar dagslånekostnaderna i grossistledet i euro utan säkerhet för banker som är belägna i euroområdet. Den dagliga sammansatta €STR beräknas och publiceras av Europeiska centralbanken ("ECB"). Beräkningsmetoden för €STR är tillgänglig på:

[https://www.ecb.europa.eu/stats/financial\\_markets\\_and\\_interest\\_rates/euro\\_short\\_term\\_rate/html/index.en.html](https://www.ecb.europa.eu/stats/financial_markets_and_interest_rates/euro_short_term_rate/html/index.en.html).

Indexberäkningsmetod:

$$\text{Index}(t) = \text{Index}(T) \times [1 - (\text{Dax}(t)/\text{Dax}(T) - 1)] + \text{Index}(T) \times (2 \times \text{€STR}(T) - \text{Cm}) \times d/360$$

Där:

Index(t) = indexnivå vid värderingstidpunkten t

Index(T) = indexstängningskurs på föregående värderingsdatum T

DAX(t) = basindexnivå vid värderingstidpunkten t

DAX(T) = stängningskurs för basindexet på föregående värderingsdatum T

€STR(T) = den korta euroräntan på föregående värderingsdatum T

Cm = månatliga fastställda kostnader för värdepappersutlåning

d = antal dagar mellan värderingsdatumet och föregående värderingsdatum T

Investerare bör vara medvetna om att indexet nästan återspeglar det dagliga resultatet för basindexet och gör det i procent och inte i absoluta tal. Om basindexet stiger och sedan faller med exakt samma antal punkter på följande dag, innebär detta att indexet inte kommer att uppnå sin ursprungliga nivå.

Investering i delfonden är förknippad med specifika risker om basindexet utvecklas positivt. Detta positiva resultat leder till ett negativt resultat för investeringen.

Allmän information om basindexet:

DAX® Index som beräknas av STOXX Ltd. omfattar de 30 största tyska företagen med högst omsättning som är noterade på Frankfurtbörsen (hädanefter "indexkomponenterna"). Indexet beräknas som ett resultatindex, dvs. tar hänsyn till kontoutdelnings- och bonusbetalningar av indexkomponenterna i indexberäkningen. En viktningssgräns på 10 % gäller för alla indexkomponenter. Indexets sammansättning och viktningen av indexkomponenterna granskas kvartalsvis i mars, juni, september och december. Omviktning av transaktioner påverkar inte de avgifter som ska betalas av delfonden och påverkar därför inte delfondens resultat.

Ovanstående indexöversikt sammanfattar indexets viktigaste egenskaper vid den tidpunkt då detta prospekt utarbetades, men avser inte att ge en fullständig indexbeskrivning. Mer information om indexet finns på indexadministratörens webbplats. Investerare uppmanas att regelbundet inhämta information från ovan nämnda webbplats om den aktuella indexsammansättningen eller eventuella indexjusteringar eller ändringar (t.ex. med avseende på den tillämpade beräkningsmetoden). Om det finns avvikelser mellan ovanstående index- eller basindexsammanfattning och indexleverantörens fullständiga indexbeskrivning ska indexleverantörens fullständiga beskrivning gälla.

- Indexrevision

Indexets ombalansering planeras ske kvartalsvis.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av STOXX.

Värdet för SHORTDAX Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SHORTDAX

Det resultat som följs är stängningskursen för SHORTDAX Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stox.com](http://stox.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                                                  |                |
|--------------------------------------------------|----------------|
| Derivat                                          | Hävtång        |
| Aktieexponering                                  | Förvaltning    |
| Säkringsrisk                                     | (säkradMarknad |
| andelsklass)                                     | Volatilitet    |
| Indexreplikering                                 | Hållbarhet     |
| Indirekt replikering                             |                |
| Investeringsfond                                 |                |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                |

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som:

- förstår riskerna med delfonden
- förstår indexets komplexitet
- och önskar en mycket kortsiktig investeringshorisont för indexet, t.ex. för dagshandel.

Delfonden kan tilltala investerare som vill replikera indexets resultat

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

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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 %     | 0,20 %            | 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](https://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 SHORTDAX Index® och relaterade varumärken för användning i samband med AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE.

STOXX och dess licensgivare:

- sponsrar, stöder, säljer eller marknadsför inte AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE.
- rekommenderar inte att någon ska investera i AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE eller andra värdepapper.
- har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE.
- har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE.
- beaktar inte behoven hos AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE eller ägarna av AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE när SHORTDAX Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
- De resultat som kan erhållas av AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE, ägare av AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE eller andra personer i samband med användningen av SHORTDAX Index och data i SHORTDAX Index®.
- Att SHORTDAX Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
- Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av SHORTDAX Index® och dess data.
- STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i SHORTDAX Index® 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 AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE eller andra tredje parter.

# AMUNDI GERMAN BUND DAILY (-1X) INVERSE<sup>(1)</sup>

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Solactive Bund Daily (-1x) Inverse Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Indexbeskrivning

- Allmän beskrivning av indexet

Indexet följer resultatet för en hypotetisk räntebärande investering i de underliggande obligationsterminerna, med investeringen rullande från ett kontrakt till nästa med hänsyn till likviditetsposition och transaktionskostnader.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Solactive Bund Daily (-1x) Inverse Index är knutet till resultatet för Euro Bund-terminen och återspeglar resultatet för en investering med en kort position i Euro Bund-terminen plus beaktande av en likviditetsposition och transaktionskostnader.

Euro Bund-terminen avser en syntetisk 10-årig obligation emitterad av Förbundsrepubliken Tyskland. Det är det mest likvida och viktiga terminskontraktet inom det europeiska räntebärande segmentet och betraktas därmed som ett jämförelseindex för den effektiva räntan på 10-åriga statsobligationer.

Följande förhållande gäller: Indexet faller om räntan på 10-åriga obligationer faller och indexet stiger om den 10-åriga räntan stiger.

Investerare bör vara medvetna om att indexet nästan inverterar det dagliga resultatet för Euro Bund-terminen och gör det i procent och inte i absoluta tal. Om Euro Bund-terminen stiger och sedan faller med exakt samma antal baspunkter på efterföljande dag, innebär detta att indexet inte kommer att uppnå sin ursprungliga nivå.

Investering i delfonden medför särskilda risker om resultatet för Euro Bund-terminen är positivt. Detta positiva resultat leder till ett negativt resultat för investeringen.

### Rullningsförfarande:

När terminerna förfaller måste den rullande terminsstrategin regelbundet rulla sin exponering från ett terminskontrakt till nästa. Detta händer under rullningsperioden. En rullningsperiod inträffar varje kvartal. Den första dagen i rullningen (rullningsperiodens startdatum) är åtta bankdagar före datumet för fastställande av rullningen. Datum för fastställande av rullningen är det handelsdatum som ligger närmast den 10 mars, juni, september och december. Om den tionde i dessa månader inte är en bankdag, är datum för fastställande av rullningen den första bankdagen efter den tionde dagen i månaden. Det finns totalt fem bankdagar under en rullningsperiod, då exponeringen flyttas från den ledande kontraktsmånadsterminen till nästa kontraktsmånadstermin i fem steg om 20 %. Den sista dagen för rullningen (rullningsperiodens slutdatum) är därför bankdagen fyra handelsdagar efter rullningsperiodens början.

Närmare information om rullningsförfarandet finns i indexbeskrivningen på [www.solactive.com](http://www.solactive.com).

- Indexrevision

Ombalanseringen av indexet planeras till rullningsperioden för de underliggande obligationsterminerna.

- Index-publicering

Indexet beräknas och publiceras av Solactive.

Värdet för Solactive Bund Daily (-1x) Inverse Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SOD1BUN

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Solactive-indexet finns på [solactive.de](http://solactive.de)

(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 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSWAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

|                                                  |                    |
|--------------------------------------------------|--------------------|
| Kredit                                           | Räntesats          |
| Derivat                                          | Investeringsfond   |
| Säkringsrisk                                     | (säkradFörvaltning |
| andelsklass)                                     | Marknad            |
| 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 behålla sin investering i minst 1 dag.

Delfonden kan tilltala investerare som:

- är intresserade av investeringstillväxt på 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 16:00 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 %     | 0,10 %            | 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](http://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 NÄMNDNA FINANSIELLA INSTRUMENT ELLER REPRESENTERAR PÅ NÅGOT SÄTT EN FÖRSÄKRAN ELLER ETT YTTRANDE FRÅN SOLACTIVE AG OM EVENTUELLA INVESTERINGAR I DETTA FINANSIELLA INSTRUMENT.

## 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

Bloomberg Global Corporate IG Select Index 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
- Indexsammansättning

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.

Värdet på Bloomberg Global Corporate IG select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37936US

Vid indexberäkningen används köpkurser. Den inledande kursen för nya företagsemissioner som tas med i indexet är säljkursen. Efter den första månaden används köpkursen.

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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla vissa värdepapper som inte är underliggande komponenter i indexet, men den måste följa kreditbetyg och OECD-kriterier för att innehålla 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 innehålla några värdepapper från företag som är inblandade i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen enligt definitionen i "Replikeringsmetoder".

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla 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:** 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                                 | 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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    | 500 000 USD                  | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg Global Corporate IG select är tjänstemärken tillhörande 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 AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg Global Corporate IG select Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG när Bloomberg Global Corporate IG select Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av timing, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN OCH/ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG GLOBAL CORPORATE IG SELECT INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA, OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG GLOBAL CORPORATE IG SELECT INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG GLOBAL CORPORATE IG SELECT INDEX ELLER DATA DÄR. 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 AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG ELLER BLOOMBERG GLOBAL CORPORATE IG SELECT INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.

# AMUNDI FTSE EPRA NAREIT GLOBAL DEVELOPED

## 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

FTSE EPRA/NAREIT Developed Index 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
- Indexsammansättning

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 utifrån:

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

Värdet för FTSE EPRA/NAREIT Developed Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: TRNGLE

Det resultat som följs är stängningskursen för FTSE EPRA/NAREIT Developed Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](http://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 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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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) |
| UCITS ETF ACC  | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,35 %            | 0,10 %               |
| 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI FTSE EPRA NAREIT GLOBAL DEVELOPED SUB-FUND REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE") ELLER AV LONDON STOCK EXCHANGE PLC ("BÖRSEN") 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 FTSE EPRA/NAREIT Developed Index ("INDEXET") ELLER DEN SIFFRA SOM DETTA INDEX STÅR 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 USD CORPORATE BOND 1–5Y ESG

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI 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

Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som är representativt för företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index ("överordnat index"), med en återstående löptid på mellan ett och fem år i slutet av varje månad och tillämpar ytterligare löptids- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla värdepapper som ingår i det överordnade indexet (dvs. företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i USD och offentligt emitterade) med en återstående löptid på mellan ett och fem år i slutet av varje månad och 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.

Värdet för Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37545US

Indexet följer resultatet som fastställs kl. 16.00 New York-tid. Vid indexberäkningen används köpkurser. Den inledande kursen för nya företagsemissioner som tas med i indexet är säljkursen. Efter den första månaden används köpkursen.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** 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                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |



## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,04 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF EUR HEDGED ACC | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

"Bloomberg®" och Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI är servicemärken som tillhör Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och servicemärken och Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI USD CORPORATE BOND 1–5Y ESG. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI USD CORPORATE BOND 1–5Y SRI när Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 1–5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 UNDERFÖRSTÄDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI USD CORPORATE BOND 1–5Y SRI ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 1–5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG HÄRMED UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 1–5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 SKADOR – VARE SIG DIREKTA, INDIREKTA, EFTERFÖLJANDE, TILFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI USD CORPORATE BOND 1–5Y ESG ELLER BLOOMBERG MSCI US CORPORATE 1–5 YEAR ESG SUSTAINABILITY SRI INDEX 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 SMALL CAP ESG CTB NET ZERO AMBITION

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select 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

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Small Cap Index ("överordnat index"), representativt värdepapper från små bolag på utvecklade marknader från länder i den europeiska ekonomiska och monetära unionen (EMU). Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. 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.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade utslutningar och en optimeringsprocess för att öka MSCI 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, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Net EUR Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEMSCCT

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Net EUR Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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".

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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

Fonden har hög volatilitet på grund av sin exponering mot aktiemarknader

|                  |                                       |
|------------------|---------------------------------------|
| Derivat          | Marknad                               |
| Aktieexponering  | Aktier i små och medelstora företag   |
| Indexreplikering | Hållbara investeringar                |
| Investeringsfond | Användning av tekniker och instrument |
| Förvaltning      |                                       |

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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,30 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DIST | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

AMUNDI MSCI EMU SMALL CAP ESG CTB NET ZERO AMBITION ("DELFONDEN") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG. MSCI-INDEXEN HAR LICENSIERATS FÖR ANVÄNDNING I VISSA SYFTEN AV AMUNDI. INGEN MSCI-PART GER UTFÄSTELSER ELLER GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÄTT, TILL EMITTENTEN ELLER ÄGARNÄ 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 PÄLITLIGA 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 UNDERFÖRSTÄDDA, 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 UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER AV NÅGOT SLAG, OCH MSCI-PARTERNA FRÄNSÄGER SIG HÄRMEDE 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPET FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÄDANA 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

STOXX Europe Select Dividend 30 Index 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
- Indexsammansättning

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).

Värdet för STOXX Europe Select Dividend 30 Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: SD3R

Det resultat som följs är stängningskursen för STOXX Europe Select Dividend 30 Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i STOXX-index finns på [stox.com](http://stox.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.

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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

**Plan d'Epargne en Actions (PEA):** Berättigad

**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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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

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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswap 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

Fonden 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 17:00 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:**

**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 %     | 0,20 %            | 0,10 %               |
| 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](http://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 STOXX Europe Select Dividend 30 Index® och relaterade varumärken för användning i samband med Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30.

STOXX och dess licensgivare:

- Sponsrar, marknadsför, säljer eller främjar inte Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30.
- Rekommenderar inte att någon ska investera i Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30 eller andra värdepapper.
- Har inget ansvar för att fatta beslut om tidpunkter, mängder eller prissättning av Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30.
- Har inget ansvar för administration, förvaltning eller marknadsföring av Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30.
- Beaktar inte behoven hos Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30 eller ägarna av Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30 när STOXX Europe Select Dividend 30 Index fastställs, sammanställs eller beräknas och har ingen skyldighet att göra det.

STOXX och dess licensgivare har inget ansvar i anknytning till Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30. Mer specifikt:

- STOXX och dess licensgivare ger inga garantier, varken uttryckliga eller underförstådda, och fransäger sig alla garantier beträffande följande:
  - De resultat som kan erhållas av Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30, ägaren av Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30 eller andra personer i samband med användningen av STOXX Europe Select Dividend 30 Index och data i STOXX Europe Select Dividend 30 Index®.
  - Att STOXX Europe Select Dividend 30 Index och dess data är korrekta eller fullständiga.
  - Säljbarhet och lämplighet för ett visst ändamål eller användning av STOXX Europe Select Dividend 30 Index® och dess data.
  - STOXX och dess licensgivare har inget ansvar för eventuella fel, utelämnanden eller avbrott i STOXX Europe Select Dividend 30 Index® eller dess data.
- STOXX eller dess licensgivare ansvarar under inga omständigheter för förlorad vinst eller indirekta, skadestandsberättigande, 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 Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30 eller andra tredje parter.

# AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index ("indexet") och minimerar 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

Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index ("indexet") är konstruerat utifrån Bloomberg US Corporate Index ("överordnat index") och avser att vara representativt för den USD-denominerade marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg och samtidigt uppfylla och överträffa minimikraven i förordningen om 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 10 % 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I37953US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,07 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF DIST            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närtstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index,, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI USD BOND PAB NET ZERO AMBITION. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION när Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning till kunder till AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI USD CORPORATE PARIS ALIGNED GREEN TILTED INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI USD CORPORATE PARIS ALIGNED GREEN TILTED INDEX 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 SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI USD CORPORATE PARIS ALIGNED GREEN TILTED INDEX ELLER DATA DÄRI. 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 AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION ELLER BLOOMBERG MSCI USD CORPORATE PARIS ALIGNED GREEN TILTED INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.

# AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable 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

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 ("överordnat index") 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index omfattar företagsobligationer (industriella, allmännyttiga och finansiella institutioner), prioriterade och efterställda obligationer med en återstående löptid på minst ett år, 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.

Värdet för Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35279US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

|                                                  |                                          |    |
|--------------------------------------------------|------------------------------------------|----|
| Kredit                                           | Investeringsfond                         |    |
| Valuta                                           | Förvaltning                              |    |
| Derivat                                          | Marknad                                  |    |
| Säkringsrisk<br>(andelsklass)                    | (säkradReplikering<br>samplingsindex     | av |
| Indexreplikering                                 | Hållbara investeringar                   |    |
| Räntesats                                        | Användning av tekniker och<br>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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DIST            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närliggande 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 AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG när Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning till kunder till AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER NÅGRA DATA RELATERADE TILL DETTA OCH SKA INTE HA NÅGOT ANSVAR FÖR EVENTUELLA FEL, UTELÄMNANDEN ELLER AVBROTT DÄR. BLOOMBERG LÄMNAR INGA GARANTIER, VARKEN UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI US CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI US CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX 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, TILFÄLLIG, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG ELLER BLOOMBERG MSCI US CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.

# AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable 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

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 fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index inkluderar 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 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.

Värdet för Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I35259EU

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 innehålla 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla 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

|                                                  |                                       |
|--------------------------------------------------|---------------------------------------|
| Kredit                                           | Investeringsfond                      |
| Valuta                                           | Förvaltning                           |
| Derivat                                          | Marknad                               |
| Säkringsrisk                                     | (säkradReplikering av                 |
| andelsklass)                                     | samlingsindex                         |
| 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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.

|                                           |                           |
|-------------------------------------------|---------------------------|
| <b>Publiceringsdag för substansvärde:</b> | <b>Transaktionsdag +1</b> |
| <b>Byta in/ut</b>                         | 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 %     | 0,15 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF DIST | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index är tjänstemärken tillhörande 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 AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, handelsnamn och tjänstemärken och Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna av AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG när Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller något ansvar, inklusive och utan begränsning till kunder till AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX 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 AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE AV AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV MSCI EURO CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER DATA RELATERADE TILL DETTA. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÅDDA GARANTIER OCH FRISKRIVER SIG UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST ÄNDAMÅL ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX 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 AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG ELLER BLOOMBERG MSCI EURO CORPORATE HIGH YIELD SRI SUSTAINABLE INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM MÖJLIGHETEN TILL DETTA MEDDELAS.



# AMUNDI FIXED MATURITY 2027 ITALY BTP GOVERNMENT BOND

## 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

Italy Government 2027 Maturity Index är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdet medlemsland Italien med förfallodag 2027.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 01 januari 2027 och den 15 december 2027.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde med ett tak på 28 %.

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 statsskuldsväxel 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 utifrån:

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

Värdet för FTSE Italy Government 2027 Maturity Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIT27

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**Delfondens basvaluta:** Euro

### Investeringsförvaltare

Amundi Asset Management

## 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*                     |

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

\*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.

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| Standard                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,05 %            | 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](http://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI FIXED MATURITY 2027 ITALY BTP GOVERNMENT BOND SPONSORAS, 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 LÅMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÅSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Italy Government 2027 Maturity Index ("INDEXET") ELLER DEN SIFFRA VID VILKEN DETTA INDEX STÅR 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

## 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

German Government 2027 Maturity Index är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdet medlemsland Tyskland med förfallodag 2027.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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 01 januari 2027 och den 15 december 2027.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde med ett tak på 28 %.

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 statsskuldsväxel 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 utifrån:

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

Värdet för FTSE German Government 2027 Maturity Index 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 [ftse.com](https://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.

Delfonden tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING 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                            | Marknad                               |
| Derivat                           | Replikering av samplingsindex         |
| Säkringsrisk (säkrad andelsklass) | Hållbarhet                            |
| Indexreplikering                  | Användning av tekniker och instrument |
| Räntesats                         | Fast förfallodag*                     |

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

\*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.

### Risker vid ovanliga marknadsförhållanden

|                            |                 |
|----------------------------|-----------------|
| Motpart                    | Likviditet      |
| Operativ                   | Standardmetoder |
| Standard                   |                 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,05 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI FIXED MATURITY 2027 GERMAN BUND GOVERNMENT BOND 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 LÅMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÅSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE German Government 2027 Maturity Index ("INDEXET") ELLER DEN SIFFRA VID VILKEN DETTA INDEX STÅR 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

## 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

FTSE Euro Broad Government 2028 Maturity Index är ett obligationsindex som är representativt för statsobligationer med fast ränta som är denominerade i euro och har emitterats av euroområdet medlemsländer med förfallodag 2028.

Indexet är ett totalavkastningsindex: kupongutbetalningar från indexets beståndsdelar ingår i indexets avkastning.

- Indexvaluta: Euro
- Indexsammansättning

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.
- Kapitalbelopp och ränta måste vara denominerade i euro
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 01 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 med ett tak på 28 %.

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 statsskuldsväxel 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 utifrån:

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

Värdet för FTSE euro Broad Government 2028 Maturity Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: CFIEB28

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla 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 totalavkastningssvappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING OCH TOTALAVKASTNINGSSVAPPAR".

**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         |
| Säkringsrisk (säkrad andelsklass) | Hållbarhet                            |
| Indexreplikering                  | Användning av tekniker och instrument |
| Räntesats                         | Fast förfallodag*                     |
| Investeringsfond                  |                                       |

Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass)

\*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.

### 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,05 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND BROAD SPONSORAS, 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 LÅMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÅSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Euro Broad Government 2028 Maturity Index ("INDEXET") ELLER DEN SIFFRA VID VILKEN DETTA INDEX STÅR 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 +

## 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

Euro Yield+ Government 2028 Maturity Index 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
- Indexsammansättning

Den ursprungliga sammansättningen av indexet bestäms med hjälp av följande regler:

- Statsobligationer med fast ränta
- Godtagbara emitterande länder: Italien, Portugal och Spanien.
- Kapitalbelopp och ränta måste vara denominerade i euro
- Obligationernas förfallodag måste vara mellan den 01 januari 2028 och den 15 december 2028.

Viktningen av varje obligation som ingår i indexet baseras på dess marknadsvärde med ett tak på 28 %.

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 (statsskuldväxlar). 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 utifrån:

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

Värdet för FTSE Euro Yield+ Government 2028 Maturity Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: CFIIY28

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i FTSE-index finns på [ftse.com](https://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 innehåller alla underliggande komponenter i indexet eller att den innehåller dem i samma proportion som deras viktningar i indexet. Delfonden kan även innehålla 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 tar inte med en bedömning av miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet (som föreskrivs i taxonomiförordningen) i sin förvaltningsprocess. I enlighet med taxonomiförordningen bör det därför noteras att de investeringar som ligger till grund för delfonden inte tar hänsyn till EU:s kriterier för miljömässigt hållbar ekonomisk verksamhet.

### 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 på högst 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 innehålla 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 VÄRDEPAPERSFINANSIERING 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         |
| Säkringsrisk (säkrad andelsklass)                | Hållbarhet                            |
| Indexreplikering                                 | Användning av tekniker och instrument |
| Räntesats                                        | Fast förfallodag*                     |
| Investeringsfond                                 |                                       |
| Likviditet på noteringsmarknad (ETF-andelsklass) |                                       |

\*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.

### 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %     | 0,05 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

DELFONDEN AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND YIELD + 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 LÅMNAR NÅGON FORM AV GARANTI ELLER UTFÅSTELSE, UTTRYCKLIGEN ELLER UNDERFÖRSTÅDD, VARE SIG GÄLLANDE RESULTATEN SOM KAN ERHÅLLAS GENOM ATT ANVÄNDA FTSE Euro Yield+ Government 2028 Maturity Index ("INDEXET") ELLER DEN SIFFRA VID VILKEN DETTA INDEX STÅR 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 CTB NET ZERO AMBITION

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för MSCI EM Asia 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

MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EM Asia Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapper för stora och medelstora bolag på tillväxtmarknadsländer i Asien. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimistandarderna i förordningen för EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet, 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 utifrån:

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

Värdet för MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Index finns tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: MXEFAECT

Det resultat som följs är stängningskursen för MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Index.

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i MSCI-index finns på [msci.com](https://www.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 innehålla 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 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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 innehålla positioner 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:** US-dollar

### Investeringsförvaltare

Amundi Japan Ltd

## Huvudsakliga risker

Se "Riskbeskrivningar" för mer information.

### Risker vid normala marknadsförhållanden

Fonden 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 |
| <b>Riskhanteringsmetod</b> | Engagemang      |

## Planera din investering

Utformad för investerare som förstår riskerna med att investera i delfonden och som avser 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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) |
| UCITS ETF ACC  | USD    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | 1,00 %     | 0,15 %            | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Amundi MSCI EM Asia ESG CTB Net Zero Ambition ("Delfonden") SPONSRAS, REKOMMENDERAS, SÄLJS ELLER MARKNADSFÖRS INTE AV MSCI INC. ("MSCI") ELLER DESS NÄRSTÄENDE FÖRETAG, INFORMATIONSLIVERANTÖRER 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 NÄRSTÄENDE 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 NÄRSTÄENDE FÖRETAG ÄR LICENSGIVARE AV VISSA VARUMÄRKEN, TJÄNSTEMÄRKEN OCH HANDELSNAMN SAMT AV MSCI-INDEX SOM FASTSTÄLLS, SÄTTES 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 FRÄNSÄGER 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 OVANSTÄENDE HAR INGEN MSCI-PART UNDER NÅGRA SOM HELST OMSTÄNDIGHETER NÅGOT ANSVAR FÖR DIREKTA, INDIREKTA, SÄRSKILDA, SKADESTÄNDSBERÄTTIGANDE, EFTERFÖLJANDE ELLER ANDRA SKADOR (INBEGRIPE FÖRLORAD VINST) ÄVEN OM DE MEDDELATS RISKEN FÖR SÅDANA SKADOR.

# AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED

## Mål och placeringsinriktning

### Mål

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1–5 Year 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

Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index är ett obligationsindex som består av skuldförbindelser från företag i flera valutor med fast ränta, höga kreditbetyg 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.

- Indexvaluta: US-dollar
- Indexsammansättning

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.

Värdet för Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1–5 Year Index är tillgängligt via Bloomberg. På prospektets datum används följande kortnamn: I38487US

Metod, sammansättning, granskningsregler och ytterligare information om underliggande komponenter i Bloomberg-indexet finns på [bloomberg.com](https://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

Den aktiva risken mäter volatiliteten i skillnaden mellan delfondens och indexets avkastning. Under normala marknadsförhållanden förväntas delfonden följa indexets utveckling med en aktiv risk på högst 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 största och förväntade proportionerna av delfondens tillgångar som kan bli föremål för transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar visas i tabellen "ANVÄNDNING AV TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING 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 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".

**Tidsgräns för transaktioner:** 14:00 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:**

**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 %                           | %          | 0,07 %            | 0,07 %               |
| UCITS ETF EUR Hedged Acc  | EUR    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | %          | 0,06 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF GBP Hedged Dist | GBP    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | %          | 0,06 %            | 0,10 %               |
| UCITS ETF USD HEDGED Acc  | USD    | 1 000 000 USD                | 3,00 %                           | %          | 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](https://amundi.lu/amundi-index-solutions)

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

## Indexleverantörens friskrivning

Bloomberg® och Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1–5 Year Index är tjänstemärken tillhörande Bloomberg Finance L.P. och dess närstående företag, inklusive Bloomberg Index Services Limited ("BISL"), administratören för 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 AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED eller någon i allmänheten avseende lämpligheten att investera i värdepapper i allmänhet eller i AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED i synnerhet. Det enda förhållandet mellan Bloomberg och Amundi Asset Management är licensiering av vissa varumärken, varunamn och servicemärken och Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1–5 Year Index, som fastställs, sätts samman och beräknas av BISL utan hänsyn till Amundi Asset Management eller Bloomberg AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED. Bloomberg har ingen skyldighet att ta hänsyn till Amundi Asset Management eller ägarna till AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED när Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1–5 Year Index fastställs, sätts samman eller beräknas. Bloomberg ansvarar varken för eller har deltagit i fastställandet av tidpunkter, kurser eller kvantiteter av emissioner i AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED. Bloomberg ska inte ha någon skyldighet eller ansvar, inklusive och utan begränsning till investerare i AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED, avseende administration, marknadsföring eller handel med AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED.

BLOOMBERG GARANTERAR INTE RIKTIGHETEN ELLER FULLSTÄNDIGHETEN FÖR BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE A+ ESG SUSTAINABILITY SRI 1–5 YEAR INDEX 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 UNDERFÖRSTÄDDA, BETRÄFFANDE RESULTAT SOM KAN UPPNÅS AV AMUNDI ASSET MANAGEMENT, ÄGARE TILL AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED ELLER NÅGON ANNAN PERSON ELLER ENHET TILL FÖLJD AV ANVÄNDNINGEN AV BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE A+ ESG SUSTAINABILITY SRI 1–5 YEAR INDEX ELLER DATA DÄRI. BLOOMBERG LÄMNAR INGA UTTRYCKLIGA ELLER UNDERFÖRSTÄDDA GARANTIER, OCH FRISKRIVER SIG HÄRMEDE UTTRYCKLIGEN FRÅN ALLA GARANTIER OM SÄLJBARHET ELLER LÄMPLIGHET FÖR ETT VISST SYFTE ELLER ANVÄNDNINGSSOMRÅDE VAD BETRÄFFAR BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE A+ ESG SUSTAINABILITY SRI 1–5 YEAR INDEX ELLER DATA DÄRI. UTAN ATT DETTA PÅVERKAR NÅGOT AV DET OVANSTÄENDE, 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, FÖLJDSKADOR, TILLFÄLLIGA, SKADESTÅNDSBERÄTTIGANDE ELLER PÅ ANNAT SÄTT – SOM UPPSTÅR I SAMBAND MED AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED ELLER BLOOMBERG MSCI GLOBAL CORPORATE A+ ESG SUSTAINABILITY SRI 1–5 YEAR INDEX ELLER NÅGRA DATA ELLER VÄRDEN RELATERADE TILL DESSA – OAVSETT OM DE UPPSTÅR PÅ GRUND AV FÖRSUMLIGHET ELLER PÅ ANNAT SÄTT, ÄVEN OM DE MEDDELAS OM MÖJLIGHETEN DÄRAV.

## NOTERINGAR OM DELFONDSKOSTNADER

---

Dessa noteringar gäller endast för andelsklasstabellerna i "delfondsbeskrivningarna".

**Allmänt** De avgifter du betalar när du investerar i delfonden går till att täcka driftskostnaderna för delfonden, inklusive kostnaderna för att marknadsföra och distribuera den.

Dessa årliga avgifter minskar investeringens resultat.

**Engångsavgifter som debiteras före eller efter investeringstillfället** Dessa kan dras av från din investering eller din inlösenbehållning, och betalas till försäljningsombud och auktoriserade förmedlare. De avgifter som visas är maximibelopp. För att ta reda på den faktiska avgiften för en transaktion, kontakta din finansiella rådgivare eller ditt överföringsombud (avsnittet "SICAV-fonden").

**Avgifter som debiteras fonden under året** Dessa är samma för alla andelsägare i en viss andelsklass.

# HÅLLBAR INVESTERING

## Disclosureförordningen

den 18 december 2019 meddelade Europeiska rådet och Europaparlamentet att de hade nått en politisk överenskommelse om disclosureförordningen och därigenom försöker att upprätta 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](http://www.amundi.lu)

## Kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288 av den 06 april 2022

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 01 januari 2023.

**I enlighet med artikel 14.2 i de tekniska standarderna för tillsyn, 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 även i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt.

## Översikt över policyn för ansvarsfulla investeringar

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 passivt förvaltade delfonder utesluter därför Amundi kontroversiella vapentillverkare 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 en metod för företag som är 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 insikter till beslutsprocessen.

Amundis ESG-betyg är en ESG-kvantitativ 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. Miljödimensionen: I denna undersöks 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.

Metoden som tillämpas av Amundis ESG-betyg använder 38 kriterier (per den 02 januari 2023) som antingen är generiska (gemensamma för alla företag oavsett deras verksamhet) eller sektorspecifika och som är viktade enligt sektor och som beaktas i fråga om inverkan på en emittents anseende, operativa effektivitet och bestämmelser.

Mer information om de 38 kriterier som Amundi beaktar (per den 02 januari 2023) finns i policyn för ansvarsfulla investeringar och Amundis ESG Regulatory Statement på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu).

I Amundis ESG-betyg beaktas också potentiella negativa hållbarhetskonsekvenser från emittentens verksamhet (investeringsbesluts huvudsakliga negativa konsekvenserna 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, kriterier för ansvarsfull skogsförvaltning)
- vatten (vattenkriterier)
- avfall (avfall, återvinning, biologisk mångfald och föroreningskriterier)
- sociala och arbetsrelaterade frågor (kriterier för samhällsengagemang och mänskliga rättigheter, kriterier för anställningsförfaranden, kriterier för styrelsestruktur, kriterier för arbetsmarknadsrelationer samt kriterier för hälsa och säkerhet)
- mänskliga rättigheter (kriterier för samhällsengagemang och mänskliga rättigheter)
- antikorrupktion 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 ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.com](http://www.amundi.com)

*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 EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG  
AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG  
AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG  
AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG  
AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND  
AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG  
AMUNDI GLOBAL AGG SRI  
AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5  
AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED  
AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y  
AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG  
AMUNDI INDEX EURO AGG SRI  
AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI  
AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y  
AMUNDI INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB  
AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB  
AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB  
AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB  
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB  
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB  
AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB  
AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB  
AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB  
AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB  
AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB  
AMUNDI INDEX US CORP SRI  
AMUNDI ITALY MIB ESG  
AMUNDI MDAX ESG  
AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT  
AMUNDI MSCI CHINA DISRUPTIVE TECHNOLOGY ESG SCREENED  
AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT  
AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS  
AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT  
AMUNDI MSCI EMU CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB  
AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION  
AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT  
AMUNDI MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT  
AMUNDI MSCI EUROPE CLIMATE PARIS ALIGNED PAB  
AMUNDI MSCI EUROPE CLIMATE TRANSITION CTB  
AMUNDI MSCI EUROPE ESG UNIVERSAL SELECT  
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS  
AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB  
AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB  
AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB  
AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED  
AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB  
AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT  
AMUNDI MSCI USA ESG UNIVERSAL SELECT  
AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB  
AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB  
AMUNDI MSCI WORLD ESG LEADERS SELECT  
AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT  
AMUNDI S&P 500 ESG  
Amundi Stoxx Europe 600 ESG  
AMUNDI US AGG SRI  
AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI  
AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG  
AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS  
AMUNDI MSCI SMART CITIES ESG SCREENED  
AMUNDI MSCI EM ASIA ESG CTB NET ZERO AMBITION  
AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED

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.

## 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 beaktar Amundi huvudsakliga negativa konsekvenser 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.

För alla andra delfonder som inte klassificeras enligt artikel 8 eller artikel 9 i förordningen om hållbarhetsupplysningar beaktar Amundi ett urval av huvudsakliga negativa konsekvenser genom sin normativa uteslutningspolicy, och 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 kommer att beaktas för dessa delfonder.

Närmare information om huvudsakliga negativa konsekvenser finns i Amundis ESG Regulatory Statement på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

Delfonderna angivna nedan beaktar i investeringsprocessen investeringars huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer. Det sker genom att utesluta värdepapper från företag delaktiga i produktion eller försäljning av kontroversiella vapen. Dessa delfonder integrerar inte hållbarhetsrisker i investeringsprocessen eftersom dess mål är att så nära som möjligt replikera utvecklingen för ett jämförelseindex som inte tar hänsyn till sådana risker i sin metod:

AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART  
ALLOCATION SCIENTIFIC BETA  
AMUNDI INDEX EURO CORP BBB 1-5  
AMUNDI INDEX GLOBAL AGG 500M  
AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND  
AMUNDI INDEX FTSE EPRA NAREIT GLOBAL  
AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND  
AMUNDI INDEX J.P. MORGAN GBI GLOBAL GOVIES  
AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS  
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE  
AMUNDI INDEX MSCI WORLD  
AMUNDI PRIME EMERGING MARKETS  
AMUNDI EUR CORPORATE BOND  
AMUNDI PRIME EURO GOV BONDS 0-1Y  
AMUNDI PRIME EURO GOVIES  
AMUNDI PRIME EUROPE  
AMUNDI PRIME EUROZONE  
AMUNDI PRIME GLOBAL  
AMUNDI PRIME GLOBAL GOVERNMENT BOND  
AMUNDI PRIME JAPAN  
AMUNDI PRIME UK MID AND SMALL CAP  
AMUNDI PRIME US CORPORATES  
AMUNDI PRIME US TREASURY  
AMUNDI PRIME US TREASURY BOND 0-1 Y  
AMUNDI PRIME USA  
AMUNDI DAX  
AMUNDI DJ SWITZERLAND TITANS 30  
AMUNDI DIVDAX  
AMUNDI SDAX  
AMUNDI EURO STOXX 50  
AMUNDI F.A.Z. 100  
AMUNDI NYSE ARCA GOLD BUGS  
AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG

Övriga delfonder, som inte anges ovan, 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.

Alla investeringar innebär risk. Riskerna med en del av dessa delfonder kan vara förhållandevis höga.

Risikbeskrivningarna 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, eventuella delfonder kan påverkas av andra risker i detta avsnitt samt risker som inte nämns här, och risikbeskrivningarna 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. Riskerna kan också leda till att en fond 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.*

**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 handelsvolymen (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. En del 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.

**Kreditrisk** Risken att en obligation eller ett penningmarknadspapper ska 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 "Risk för betalningsinställelse" under "Risk för ovanliga marknadsförhållanden"), även om vanliga förhållanden råder på den allmänna marknaden.

**Valutarisk** Förändringar i valutakurserna kan minska investeringsvinster 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** Motpartsrisiker som uppstår via investeringar i OTC-derivat och värdepapperslån och återköpsavtal dämpas vanligtvis med en överlåtelse 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 värdepappren 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.

**Risker med derivatinstrument** 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.

### 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 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-aktieklasser 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 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 följer indexets löptid, får denna delfond ett ökande belopp av likvida medel från de obligationerna som förfaller (med förbehåll för eventuella fallissemang hos emittenter).

I enlighet med tillämplig indexmetod investerar en delfond med fast löptid att 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 inlånskonto. Investeringar i dessa delfonder är inte försäkrade eller garanterade av SICAV, investgeringsförvaltaren, 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 underfonder vill lösa in sina andelar före förfallodagen. Med tanke på den förändrade karaktären hos de tillgångar som innehåses under det sista året för delfonder med fast löptid förändras investerarnas risker över tid.

Investerar som investerar under det sista året kan intedra 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 följer index som fastställs, beräknas och underhålls av indexsponsor. Indexsponsor kan uppleva operativa risker som kan generera fel när det index som delfonden följer fastställs, sätts samman eller beräknas, vilket leder till förluster i delfondernas investeringar eller avvikelser från indexmålet enligt beskrivningen i indexmetoden och delfondernas beskrivning.

## 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 använda kan det vara svårt för delfonden att hitta ett motsvarande derivat någon annanstans. Detta kan resultera i att fonden går miste om vinster, eller att den blir exponerad mot risker eller förluster. Hit hör förluster på grund av en derivatposition för vilken fonden inte lyckades ta en utjämnande position. Det finns inga garantier för att värdet av de säkerheter som innehåses 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 samt 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 juridisk 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-derivatstransaktioner 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, 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 redovisningsstandarder
- manipulation av marknadspriser av stora investerare
- oförutsedda förseningar och stängningar på marknaden
- bedrägeri, korruption och misstag.

Tillväxtländer kan begränsa värdepappersinnehav för utlåningar eller ha mindre reglerad förvaringspraxis, och det gör delfonden mer sårbar för förluster och begränsade juridiska möjligheter.

I länder där delfonden, antingen på grund av bestämmelser eller för effektivitet, 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 värdepappererna, 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 fonden 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 Östeuropa, 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 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 i förhållande till valutaexponeringen i berörd delfonds portfölj). Risksäkring är förenat med kostnader som minskar investeringens avkastning.

**Risker med 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.

**Risker med investeringsfonder:** 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 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 motparts-, likviditets-, rättslig, förvarings- (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 den externa förvaltaren) 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 (<http://www.amundi.com> eller <http://www.amundi-etf.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 skuldebrev** 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 risken för betalningsinställelse som dessa värdepapper bär.

**Ränterisk** När räntan stiger sjunker vanligtvis värdet på obligationen. Ju längre löptid obligationen har, desto större är risken.

**Risk med replikering av index** 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 om att följa index kommer delfondernas resultat att följa resultatet för det specifika indexet, oavsett om resultatet stiger eller faller.

**Indirekt replikering – implikationer i form av exponering mot index och motpartsrisk** 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 göra delfonden till en innehavare av eller ge delfonden direkt investeringsposition i något av de underliggande indexvärdepapperna eller någon komponent som ingår däri. Delfonden kommer inte att ha några rättigheter med avseende på det underliggande indexet.

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 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 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 under exceptionella omständigheter är det 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 %.

**Härvstångsrisk** 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 referensskälla ökar referensskällans 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 följande:

- i) tillfälligt eller totalt stopp i indexberäkningen av indexleverantören
- ii) tillfälligt stopp på marknaden eller marknaderna där indexets underliggande värdepapper är noterade
- iii) en relevant noteringsmarknad kan inte erhålla eller beräkna delfondens indikativa substansvärde
- iv) en marknadsgarantis 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) alla andra händelser som förhindrar beräkning av delfondens indikativa substansvärde eller handel med fondens andelar.

**Förvaltningsrisk** Delfondens förvaltningsteam kan ha fel i sina analyser, antaganden eller prognoser.

Detta inkluderar prognoser för bransch, marknad, ekonomi, demografi eller andra trender.

#### 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 risken för förlängd löptid eller förtida återbetalning samt en likviditetsrisk över genomsnittet och kredit samt ränterisker.

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 bolänsinnehavarna 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.

**Risker med förlängd löptid och förtida återbetalning** Övriga 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 värdepappren 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 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.

**Risker 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 (inklusive investeringar i bolån) kan till exempel påverkas negativt av naturkatastrofer, ekonomisk nedgång, överbyggnation, förändringar i stadsplanering, skatteköjningar, 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 och/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.



**Risker med 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.

**Stilrisk:** 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 obestämmd 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 inverkan på hållbarhetsfaktorer vid val av det index vars resultat replikeras.

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 replikerade index kan ha ett investeringsområde som fokuserar på företag som uppfyller specifika kriterier, inklusive ESG-betyg, och med koppling till vissa teman för hållbar utveckling och visar att de följer praxis för miljömässiga, samhälls- och bolagsstyrningsfrågor. Följaktligen kan investeringsområdet för sådana delfonder och index vara mindre än det för andra delfonder och index. Sådana delfonder och index kan (i) utvecklas sämre än marknaden som helhet om sådana investeringar går sämre än marknaden och/eller (ii) utvecklas sämre än moderindexet eller till det indexets godtagbara investeringsområde som inte använder ESG-kriterier och/eller skulle kunna få delfonden att sälja innehav på grund av ESG-relaterade problem, varpå dessa innehav därefter utvecklas väl.

Uteslutning eller avyttring av värdepapper från emittenter som inte uppfyller vissa ESG-kriterier från indexmetoden eller delfondens investeringsområde, kan få indexet och delfonden att utvecklas annorlunda än liknande index och fonder som inte har en policy för ansvarsfulla investeringar eller ESG-komponenter i sin indexmetod och som inte tillämpar kriterier för ESG-screening vid urval av investeringar.

Delfonder kommer att fullmaktsrösta 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 röstpolicy för ESG finns på [www.amundi.com](http://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 emittent.

**Hållbarhetsrisker:** miljöhändelser, sociala händelser och bolagsstyrningshändelser samt miljöförhållanden, sociala förhållanden och bolagsstyrningsförhållanden som kan leda till faktiska och potentiella negativa konsekvenser för värdet på investeringar, däribland men inte begränsat till risker som härrör från klimatförändringar, utarmning av naturresurser, miljöförstöring, brott mot mänskliga rättigheter, mutor, korruption och sociala frågor och frågor som rör arbetstigare.

#### **Användning av tekniker och instrument:**

- **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 också utsättas för förvaringsrisk, dvs. risken för förlust av tillgångar som hålls i förvar i händelse av ett förvaringsinstitut (eller underförvaringsinstitut) insolvens, försummelse, bedrägeri, bristande förvaltning eller felaktig bokföring.

**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.

**Risk för betalningsinställelse** 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.

**Rättslig 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.

### TILLÄTNA 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 använda de investeringar som beskrivs i raderna 6 och 9, utöver vad som beskrivs i "Beskrivningar 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 banksättningar vid synhåll 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 det inom 12 månader efter emissionen.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 2. Penningmarknadsinstrument som inte uppfyller kraven i rad <sup>(1)</sup>      | Måste omfattas (antingen på värdepappersnivå eller på emittentnivå) av investerarskydd och bestämmelser för sparande och måste också uppfylla något av följande kriterier: <ul style="list-style-type: none"> <li>vara utfärdade 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</li> <li>utfärdat av en emittent eller ett företag vars värdepapper är kvalificerade enligt rad 1 ovan,</li> <li>emitterat eller garanterat av en emittent som omfattas av EU:s tillsynsregler eller andra tillsynsregler som beaktas av CSSF som likvärdiga.</li> </ul> | Kan även vara kvalificerad om emittenten tillhör en kategori som är godkänd av CSSF, omfattas av investerarskydd som motsvarar de som beskrivs till vänster och uppfyller ett av följande kriterier: <ul style="list-style-type: none"> <li>utfärdat av ett företag med ett lägsta kapital och reserver på 10 miljoner EUR och publicerar sin årsredovisning</li> <li>utfärdat av en emittent som finansierar en grupp med företag, varav minst ett av dem är börsnoterat</li> <li>utfärdat av en emittent som finansierar värdepapperiseringar som drar nytta av en bankkredit.</li> </ul> |
| 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).                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 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).                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | Den förvärvande delfonden avstår från alla rösträtter i andelar som den förvärvat. Andelarna räknas inte som tillgångar i förvärvet                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

<sup>1</sup> 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

|                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                             | Vid tidpunkten för investeringen får delfonden inte ha mer än 10 % av sina tillgångar i någon annan delfond.                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | delfond i syfte för minimigränser 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 i raderna 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: <ul style="list-style-type: none"> <li>tillhöra kategorier som godkänts av CSSF</li> <li>ha tillförlitliga dagliga värderingar som är korrekta och oberoende</li> <li>kunna säljas, likvideras eller på annat sätt avslutas till verkligt värde när som helst</li> <li>vara med motparter som är föremål för tillsyn</li> <li>ha riskprofiler som kan mätas på ett adekvat sätt</li> <li>motpartsrisken får inte överstiga 10 % av delfondens tillgångar när motparten är ett kreditinstitut eller 5 % med andra motparter.</li> </ul> |
| 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 (se nedan) 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 koncern- 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 %                    | 35 %                                                                                                                | En delfond kan investera i så få som sex emissioner om den investerar enligt principen om riskspridning och uppfyller båda av följande kriterier:<br>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.<br>2. delfonden investerar högst 30 % i en enda emission |
| B. Säkerställda obligationer* och obligationer som emitterats före den 08 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 %                    | 20 %                                                                                                                | 20 % i alla företag inom en enda emittent.<br>40 %, sammanlagt, i alla emittenter eller enheter i vilka en delfond har investerat mer än 5 % av sina tillgångar.                                                                                                                                                                                                                                                                |
| D. Insättningar hos kreditinstitut.                                                                                                                                                               | 20 %                    |                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| E. OTC-derivat med en motpart som är ett kreditinstitut enligt definitionen i rad 7 (föregående tabell).                                                                                          | 10 % exponering         | 10 %                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 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 %                    | Om det anges i relevant "delfondsbeskrivning" kan denna gräns höjas till 30 % i UCI-fonder och 100 % i UCITS-fonder | UCI-delfonder vars tillgångar är åtskilda betraktas var och en som en separat UCI-fond.<br>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 obligationsinvestorare i händelse av emittentens konkurs

FONDER SOM FÖLJER INDEX

| Komponenter                                                                                                                                          | Maximal indexviktning |                                                                                                                                            |                         |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|
|                                                                                                                                                      | I någon komponent     | Endast i en enda komponent                                                                                                                 | Övriga villkor och krav |
| A. Överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument enligt definitionen i raderna 1 och 2 i tabellen med tillåtna värdepapper och transaktioner | 20 %                  | Upp till 35 % under exceptionella omständigheter, t.ex. när värdepappret är mycket dominerande på den reglerade marknaden där det omsätts. |                         |
| 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                                                                                   |                       |                                                                                                                                            |                         |

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 kan ställas inför och emittenten 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 utan rösträtt i en och samma emittent    | 10 %                                                                              | Dessa gränser kan ignoreras vid köp om de inte kan beräknas vid den tidpunkten | - värdepapper beskrivna i rad A (föregående tabell)<br>- 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 |
| Räntepapper utan rösträtt i en emittent              | 10 %                                                                              |                                                                                |                                                                                                                                                                                                                  |
| Penningmarknadsinstrument från en och samma emittent | 10 %                                                                              |                                                                                |                                                                                                                                                                                                                  |
| 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 masterfonden 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 fondens 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 delfonderna". 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.



I efterlevnadssyfte och för riskövervakning räknas alla derivat som finns inbäddade i överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som derivat. Vidare gäller att all exponering mot överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som uppnås genom derivat (med undantag för vissa indexbaserade derivat) räknas som en investering i dessa värdepapper eller instrument.

Derivatkontrakt medför en betydande motpartsrisk. Även om delfonderna använder olika metoder för att minska exponeringen för motpartsrisk, kvarstår denna risk och kan påverka investeringsresultatet. Motparter som används av SICAV-fonden framgår av årsredovisningen.

Replikeringsmetoder för passivt förvaltd delfond

| Form av replikering  |              | Metod för replikering                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | Diversifiering (index och portfölj)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | Ytterligare information                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------------|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Indirekt replikering | Ofinansierad | <p>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 investeras i: aktier och aktierelaterade instrument, penningmarknadsinstrument och penningmarknadsfonder, för aktiedelfonder och överlåtbara skuldinstrument, konvertibler och penningmarknadsfonder för övriga delfonder.</p> <p>Swapparnas nominella belopp justeras vanligtvis dagligen, men justeras som minimum när teckningar och inlösen tas emot av delfonden.</p> <p>Det kapitalbelopp av delfondens tillgångar som omfattas av totalavkastningsswappen utgör under normala förhållanden 100 % av delfondens substansvärde och som högst 100 %.</p> <p>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.</p> | <p>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.</p> <p>Om inget annat anges i "Beskrivningen av delfonden" omfattar swappanvändningen ingen belåning. Delfondens substansvärde kommer öka (eller minska) enligt värderingen av OTC-swappen.</p> <p>Justeringar av OTC-swapkontraktets nominella värde i händelse av eventuella teckningar och inlösen kommer utföras baserat på "marknadsvärderingen".</p> <p>Värderingen av OTC-swappavtalen tillhandahålls av motparten, men förvaltningsbolaget gör sin egen oberoende värdering av dessa.</p> <p>Värderingen av OTC-swappavtalen kontrolleras av SICAV-fondens revisor under det årliga revisionsuppdraget.</p> <p>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.</p> | <p>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.</p> <p>Delfonden får inte ingå i några transaktioner med värdepappersutlåning.</p> |

|                    |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--------------------|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Direkt replikering | Full | <p>Delfonden kan genomföra sitt investeringsmål genom att investera i en portfölj av överlåtbara värdepapper eller andra godtagbara tillgångar som normalt kommer omfatta de värdepapper som utgör det finansiella indexet enligt "delfondens beskrivning" 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 (ii) om köp eller fortsatt innehav av ett sådant värdepapper skulle vara till skada för delfondens resultat eller (iii) om så anges i den berörda "delfondens beskrivning" i värdepapper i företag som är inblandade i produktion eller försäljning av följande kontroversiella vapen: antipersonella minor och klusterbomber samt vapen med utarmat uran, kemiska och biologiska vapen eller (iv) om så anges i den berörda "delfondens beskrivning" i värdepapper i företag som är inblandade i produktion eller försäljning av följande kontroversiella vapen: antipersonella minor och klusterbomber samt vapen med utarmat uran, biologiska och kemiska vapen, i värdepapper i företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller som upprepade gånger och allvarligt kränker en eller flera av de tio principerna i Global Compact*, 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.</p> <p>*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"</p> <p>Uteslutandet av dessa värdepapper grundar sig på Amundis metod enligt beskrivningen i avsnittet "Översikt över policyn för ansvarsfulla investeringar".</p> | <p>Delfonden kan också ingå transaktioner med finansiella derivatinstrument i det huvudsakliga syftet att uppnå målen under (i) och (ii) nedan, inklusive terminstransaktioner, valutaswappar, terminskontrakt, icke-leveransbaravolutaterminer, 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.</p> | <p>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 "delfondens beskrivning".</p> <p>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.</p> <p>För att begränsa en delfonds exponering mot risken för motpartens fallissemang i ett återköpsavtal, erhåller delfonden kontanter eller andra tillgångar som säkerhet.</p> <p>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.</p> |
|--------------------|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                    |                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |  |  |
|--------------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|
| Direkt replikering | Stickprovsteknik | <p>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 den berörda "delfondens beskrivning".</p> <p>En delfond får investera i ett urval av överlåtbara värdepapper som är representativa för det finansiella index som anges i den berörda "delfondens beskrivning" i proportioner som inte återspeglar deras viktning inom det finansiella indexet, så som angivet i "delfondens beskrivning", samt i förekommande fall investera i värdepapper som inte ingår i det finansiella indexet.</p> <p>Om så anges i den berörda "delfondens beskrivning" får en delfond inte investera (i) i värdepapper i företag som är inblandade i produktion eller försäljning av följande kontroversiella vapen: antipersonella minor och klusterbomber såväl som vapen med utarmat uran, biologiska och kemiska vapen eller (ii) i värdepapper som innehas av företag som bryter mot internationella konventioner om mänskliga rättigheter eller arbetsrättigheter eller som upprepade gånger och allvarligt kränker en eller flera av de tio principerna i Global Compact*, i värdepapper i företag som är verksamma inom tobaksproduktion eller -distribution, i företag med betydande exponering mot termiskt kol eller i företag med betydande exponering mot kärnvapen eller okonventionell olja och gas. Uteslutningen av dessa värdepapper grundar sig på Amundis metod.</p> <p>*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 antikorrupktion och vidta åtgärder som främjar samhällets mål"</p> <p>Uteslutandet av dessa värdepapper grundar sig på Amundis metod enligt beskrivningen i avsnittet "Översikt över policyn för ansvarsfulla investeringar".</p> |  |  |
|--------------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|

# 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 användning av någon typ av derivat utgör följande typer för närvarande de vanligaste derivat som används av delfonderna:

*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, kreditsswappar, 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 kreditsswappar (kontrakt där en konkurs, betalningsinställelse eller annan kredithändelse utlöser en betalning från den ena parten till den andra).

- TBA-derivat (terminkontrakt 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 använda derivat för säkring mot olika typer av risker, för effektiv portföljförvaltning eller för att få exponering mot vissa investeringar eller marknader.

**Valutasäkring** En delfond kan säkra direkt (genom att ta en position i en given valuta som är i motsatt riktning från den position som skapats av andra portföljinvesteringar) och korssäkra (minska faktisk exponering för en valuta samtidigt som den faktiska exponeringen för en annan ökar).

Valutasäkring kan ske på delfondsnivå och på andelsklassnivå (för andelsklasser som är säkrade mot en annan valuta än delfondens basvaluta eller mot en annan valuta än valutaexponeringen i den berörda delfondens portfölj).

När en delfond innehar tillgångar som är denominerade i flera valutor finns det en större risk för att valutafluktuationer i praktiken inte kommer att vara helt säkrade.

**Räntesäkring** Uppnås vanligtvis via delfondens användning av ränteterminer, ränteswappar eller genom olika varianter av köp- eller säljoptioner på räntor.

**Kreditrisksäkring** En delfond kan använda kreditsswappar 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.

**Durationssäkring** Syftar till att minska exponeringen mot parallella ränteväxlingar längs kurvorna. Sådan säkring kan ske på delfondnivå.

**Effektiv portföljförvaltning** Delfonderna kan använda alla tillåtna derivat för 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.

**Uppnä exponering** Delfonderna kan använda alla tillåtna derivat istället för direktinvesteringar; det vill säga för att få investeringsexponering mot alla 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 någon annan "kredithändelse".

## TEKNIKER OCH INSTRUMENT FÖR TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING

I enlighet med sin placeringsinriktning får varje delfond använda de metoder och instrument för värdepappersfinansiering som beskrivs i detta avsnitt.

Varje delfond ska se till att den alltid kan uppfylla sina inlösenkyldigheter 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 långvivaren. 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 delfond får låna ut portföljvärdepapper 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 får endast låna värdepapper i undantagsfall, t.ex.:

- 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 eller återköpa (respektive) värdepapperna 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 tillåts för dessa transaktioner måste vara förenliga med CSSF:s cirkulärbrev 08/356 och 13/559 samt 14/592.

## HANTERING AV SÄKERHETER FÖR OTC-DERIVATTRANSAKTIONER OCH TEKNIKER OCH INSTRUMENT FÖR TRANSAKTIONER FÖR VÄRDEPAPERSFINANSIERING

När en delfond ingår OTC-derivattransaktioner, däribland totalavkastningssvappar, och tillämpar tekniker och instrument för värdepappersfinansiering, bör alla säkerheter som används för att minska exponeringen mot motpartsrisker följa ESMA:s riktlinjer 2014/937 och CSSF cirkulärbrev 14/592.

### Godtagbara säkerheter

Som en del av OTC-derivattransaktioner (inklusive totalavkastningssvappar) och tillfälliga köp och försäljningar av värdepapper kan delfonden erhålla värdepapper och kontanter som garanti (säkerhet).

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:s cirkulärbrev 08/356, måste efterleva de kriterier som fastställs av förvaltningsbolaget. De måste 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](http://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](http://www.amundi.com).

### Återinvestering av tillgångar som tillhandahålls som garanti

Alla kontanter som tillhandahålls som garanti kan endast återinvesteras i enlighet med CSSF:s cirkulärbrev 08/356.

Andra tillgångar som tillhandahålls som garanti kommer inte att återanvändas.

## Driftskostnader

Nettointäkterna (som representerar bruttointäkterna minus direkta och indirekta driftskostnader och avgifter) från tekniker och instrument 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 och Poor's, vid tidpunkten för transaktionen, eller anses vara likvärdiga av förvaltningsbolaget enligt dess egna kriterier och
- görs bland välrenommerade finansiella mellanhänder på grundval av flera kriterier som rör tillhandahållande av analystjänster (grundläggande finansiell analys, företagsinformation, mervärde från partner, solid grund för rekommendationer, osv.) eller genomförandetjänster (tillgång till marknadsinformation, transaktionskostnader, genomförandepriiser, 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 delfondens 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 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

Delfonderna kommer inte tillämpa köp- och återförsäljningsavtal, sälj- och återköpsavtal, återköpsavtal eller omvända återköpsavtal, transaktioner med utlåning av värdepapper i den mening som avses i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 av den 25 november 2015 om insyn i transaktioner för värdepappersfinansiering och återanvändning (SFTR).

I enlighet med tabellen nedan använder delfonderna löpande och/eller tillfälligt transaktioner för värdepappersfinansiering och totalavkastningsswappar.

De delfonder som tillämpar en indirekt replikering kommer tillämpa TRS för att erhålla exponering mot indexresultat.

De delfonder som tillämpar en direkt replikering kan ingå värdepapperslån 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 %. Vidare kan delfonderna även påverkas av en fortlöpande anpassning av marknaden mot ett nytt regelverk. Maximal användning av värdepapperslån kommer inte överstiga 45 %, och sådana maximala gränser bestäms av förvaltningsbegränsningar.

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 -<br>förväntad (%) | Värdepapperslån - max<br>(%) | Värdepapperslån -<br>användningsvillkor (om<br>tillämpligt) | TRS - förväntad (%) | TRS - max (%) | TRS - användningsvillkor<br>(om tillämpligt) |
|-------------------------------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------|-------------------------------------------------------------|---------------------|---------------|----------------------------------------------|
| AMUNDI CAC 40 ESG                                                 | 13                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI CHINA CNY BONDS                                            | 15                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI DAX                                                        | 15                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI DAX 50 ESG                                                 | 9                                  | 25                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI DIVDAX                                                     | 15                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI DJ SWITZERLAND TITANS 30                                   | 15                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EUR CORPORATE BOND                                         | 4                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG                                | 8                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG                       | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                          | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG               | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG                                         | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND                                       | 20                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y                                  | 20                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND                          | 28                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG                                   | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EURO STOXX 50                                              | 20                                 | 25                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30                               | 20                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI F.A.Z. 100                                                 | 15                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2027 GERMAN BUND GOVERNMENT BOND            | 30                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2027 ITALY BTP GOVERNMENT BOND              | 30                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND BROAD             | 30                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND YIELD +           | 30                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL AGG SRI                                             | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5                                         | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND                                      | 12                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED                              | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y                                       | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG                                        | 10                                 | 10                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1–5Y HIGHEST RATED                    | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX                          | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                       | 20                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT                        | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GOVT BOND HIGHEST RATED EURO INVESTMENT GRADE              | 40                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE               | 9                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3           | 14                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA | 7                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI                                         | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI                                   | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y                             | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX FTSE EPRA NAREIT GLOBAL                              | 20                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX J.P. MORGAN GBI GLOBAL GOVIES                        | 24                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB                                 | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB                          | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS                                | 6                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB                        | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB                                     | 0                                  | 25                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE                                          | 30                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB                            | 10                                 | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB                                  | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB                                   | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB                     | 1                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |
| AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB                        | 0                                  | 45                           | Tillfälligt                                                 | 0                   | 0             | –                                            |



|                                                                |    |    |             |   |   |   |
|----------------------------------------------------------------|----|----|-------------|---|---|---|
| AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB                                  | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI INDEX MSCI WORLD                                        | 19 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB                                | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI INDEX US CORP SRI                                       | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND                      | 29 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 1-3Y                          | 20 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 10Y                           | 20 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI ITALY MIB ESG                                           | 9  | 25 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MDAX ESG                                                | 15 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT            | 0  | 35 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT                           | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI CHINA TECH ESG SCREENED                            | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| Amundi MSCI EM Asia ESG CTB Net Zero Ambition                  | 2  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS                               | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT               | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EMU CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB                  | 9  | 25 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION                      | 0  | 25 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT                             | 0  | 25 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT                           | 8  | 25 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EMU SMALL CAP ESG CTB NET ZERO AMBITION            | 20 | 20 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS                  | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH                                      | 25 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION                       | 10 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB            | 16 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB          | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED                         | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI SMART CITIES ESG SCREENED                          | 25 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB                                     | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT                             | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB                    | 4  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB                       | 10 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT                         | 2  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI NYSE ARCA GOLD BUGS                                     | 15 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME EMERGING MARKETS                                  | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME EURO GOV BONDS 0-1Y                               | 5  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME EURO GOVIES                                       | 39 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME EUROPE                                            | 23 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME EUROZONE                                          | 18 | 25 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME GLOBAL                                            | 16 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME GLOBAL GOVERNMENT BOND                            | 18 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME JAPAN                                             | 15 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME UK MID AND SMALL CAP                              | 19 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME US CORPORATES                                     | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME US TREASURY                                       | 8  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI PRIME USA                                               | 11 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI S&P 500 ESG                                             | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI SDAX                                                    | 15 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI STOXX EUROPE 600                                        | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| Amundi Stoxx Europe 600 ESG                                    | 9  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI US AGG SRI                                              | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 |   | – |
| AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y                                   | 16 | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI                             | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG                             | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION                | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG                    | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |
| AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                       | 0  | 45 | Tiilfalligt | 0 | 0 | – |

DELFONDER MED INDIREKT REPLIKERING

| DELFONDER                                    | Vardepapperslån -<br>förväntad (%) | Vardepapperslån - max<br>(%) | Vardepapperslån -<br>användningsvillkor (om<br>tillämpligt) | TRS - förväntad (%) | TRS - max (%) | TRS - användningsvillkor<br>(om tillämpligt) |
|----------------------------------------------|------------------------------------|------------------------------|-------------------------------------------------------------|---------------------|---------------|----------------------------------------------|
| AMUNDI FTSE EPRA EUROPE REAL ESTATE          | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI FTSE EPRA NAREIT GLOBAL DEVELOPED     | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI GERMAN BUND DAILY (-1X) INVERSE       | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI GLOBAL INFRASTRUCTURE                 | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI JAPAN TOPIX                           | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI JPX-NIKKEI 400                        | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI BRAZIL                           | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI CHINA A II                       | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EM ASIA                          | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA                 | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS                 | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EUROPE HIGH DIVIDEND FACTOR      | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY FACTOR | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EUROPE MOMENTUM FACTOR           | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR            | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI EUROPE VALUE FACTOR              | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI INDIA                            | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI NORDIC                           | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI SWITZERLAND                      | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI USA MINIMUM VOLATILITY FACTOR    | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI WORLD                            | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE                  | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI MSCI WORLD III                        | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI NASDAQ-100                            | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI PEA DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE      | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS              | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI RUSSELL 2000                          | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI S&P 500                               | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI S&P 500 BUYBACK                       | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY                     | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE          | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| AMUNDI SMART FACTORY                         | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |
| Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30       | 0                                  | 0                            | –                                                           | 100                 | 100           | Löpande                                      |

REGLER VERK 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 08 juni 2016 om index som används som referensvärden för finansiella instrument och finansiella avtal eller för att mäta investeringsfonders resultat ("benchmarkförordningen") och anges därmed inte i det register över administratörer och jämförelseindex som ESMA innehar i enlighet med artikel 36 i benchmarkförordningen.

| Jämförelseindexadministratör | Juridiskt namn för jämförelseindexadministratören | Index                                                                 | Delfond                                                        |
|------------------------------|---------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Eurozone Highest-Rated Government Bond Index                     | AMUNDI GOVT BOND HIGHEST RATED EURO INVESTMENT GRADE           |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Italy Government 2027 Maturity Index                             | AMUNDI FIXED MATURITY 2027 ITALY BTP GOVERNMENT BOND           |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE German Government 2027 Maturity Index                            | AMUNDI FIXED MATURITY 2027 GERMAN BUND GOVERNMENT BOND         |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG Index                   | AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE            |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Euro Broad Government 2028 Maturity Index                        | AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND BROAD          |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Euro Yield+ Government 2028 Maturity Index                       | AMUNDI FIXED MATURITY 2028 EURO GOVERNMENT BOND YIELD +        |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE EPRA/NAREIT Developed Index                                      | AMUNDI FTSE EPRA NAREIT GLOBAL DEVELOPED                       |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Eurozone Italy Government 1-3Y (Mid Price) Index                 | AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 1-3Y                          |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe                                     | AMUNDI FTSE EPRA EUROPE REAL ESTATE                            |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Eurozone Target Maturity Government Bond Italy (Mid Price) Index | AMUNDI ITALY BTP GOVERNMENT BOND 10Y                           |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE EPRA/NAREIT Developed Index                                      | AMUNDI INDEX FTSE EPRA NAREIT GLOBAL                           |
| FTSE                         | FTSE INTERNATIONAL LIMITED ("FTSE")               | FTSE Eurozone Lowest-Rated Government Bond IG 1-3Y Index              | AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3        |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EMU ESG Broad CTB Select                                         | AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION                      |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT                                         | AMUNDI MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT                           |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Emerging Markets                                                 | AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS                                   |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped                          | AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT                             |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index                      | AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB                       |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI WORLD                                                            | AMUNDI MSCI WORLD                                              |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index                      | AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Net EUR Index              | AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION                       |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index                               | AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB          |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped           | AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT               |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI WORLD                                                            | AMUNDI MSCI WORLD III                                          |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT                                       | AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT                         |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index                                | AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB                         |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI China ESG Leaders Select 5% Issuer Capped                        | AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT                           |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI World ex Europe                                                  | AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE                                    |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped                          | AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT                             |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe Value                                                     | AMUNDI MSCI EUROPE VALUE FACTOR                                |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe SRI Filtered PAB Index                                    | AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB                               |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EMU SRI Filtered PAB Index                                       | AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB                                  |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI USA Minimum Volatility                                           | AMUNDI MSCI USA MINIMUM VOLATILITY FACTOR                      |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe Momentum                                                  | AMUNDI MSCI EUROPE MOMENTUM FACTOR                             |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe Quality                                                   | AMUNDI MSCI EUROPE QUALITY FACTOR                              |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered Index                         | AMUNDI MSCI EMU CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB                  |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Japan SRI Filtered PAB Index                                     | AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB                                |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index                  | AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB                    |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe Growth                                                    | AMUNDI MSCI EUROPE GROWTH                                      |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index                          | AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB                     |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe High Dividend Yield                                       | AMUNDI MSCI EUROPE HIGH DIVIDEND FACTOR                        |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | Indexet MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 5% Issuer Capped | AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT            |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index                                 | AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB            |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI USA SRI Filtered PAB Index                                       | AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB                                  |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI ACWI IMI Smart Cities ESG Filtered                               | AMUNDI MSCI SMART CITIES ESG SCREENED                          |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect ESG Filtered Index        | AMUNDI MSCI CHINA TECH ESG SCREENED                            |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Net EUR Index                 | AMUNDI MSCI EMU SMALL CAP ESG CTB NET ZERO AMBITION            |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI World                                                            | AMUNDI INDEX MSCI WORLD                                        |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI World SRI Filtered PAB Index                                     | AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB                                |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI China A Index                                                    | AMUNDI MSCI CHINA A II                                         |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Emerging Markets                                                 | AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS                             |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI ACWI IMI Robotics & AI ESG Filtered Net Total Return Index       | AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED                         |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filtered PAB Index                     | AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB                     |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI India                                                            | AMUNDI MSCI INDIA                                              |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI North America ESG Broad CTB Select Index                         | AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB                  |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Index                               | Amundi MSCI EM Asia ESG CTB Net Zero Ambition                  |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EM Asia SRI Filtered PAB Index                                   | AMUNDI INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB                              |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe Minimum Volatility                                        | AMUNDI MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY FACTOR                   |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped Index                            | AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS                               |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Switzerland                                                      | AMUNDI MSCI SWITZERLAND                                        |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Nordic Countries                                                 | AMUNDI MSCI NORDIC                                             |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Emerging Markets Latam                                           | AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA                                   |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Emerging Markets Asia                                            | AMUNDI MSCI EM ASIA                                            |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index  | AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS                  |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Europe                                                           | AMUNDI INDEX MSCI EUROPE                                       |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped                          | AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS                                |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI World Climate Change CTB Select Index                            | AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB                       |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI UK IMI SRI Filtered PAB Index                                    | AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB                                     |
| MSCI                         | MSCI Limited                                      | MSCI Brazil                                                           | AMUNDI MSCI BRAZIL                                             |
| Topix                        | Tokyo Stock Exchange, Inc.                        | AMUNDI JAPAN TOPIX                                                    | AMUNDI JAPAN TOPIX                                             |

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                                                           |
|------------------------------|---------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------|
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral Index | AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5                                         |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg Global Corporate IG select                                                               | AMUNDI GLOBAL CORPORATE IG                                        |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg Global Aggregate                                                                         | AMUNDI GLOBAL AGGREGATE BOND                                      |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index                    | AMUNDI US AGG SRI                                                 |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index                                      | AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION                   |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index                                           | AMUNDI INDEX US CORP SRI                                          |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index                                       | AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                          |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index                                  | AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI                                |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index                                     | AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                          |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index          | AMUNDI GLOBAL AGG SRI                                             |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg Capital US Government Inflation-Linked Bond                                              | AMUNDI INDEX US GOV INFLATION-LINKED BOND                         |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI US Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index                                  | AMUNDI USD CORPORATE BOND 1-5Y ESG                                |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg Euro Treasury 50bn Bond Index                                                            | AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND                                       |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index                                | AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG                                |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg China Treasury + Policy Bank Index                                                       | AMUNDI CHINA CNY BONDS                                            |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year                                 | AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y                             |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg Euro Treasury 50bn 25+ Year Bond Index                                                   | AMUNDI EURO GOVERNMENT BOND 25+Y                                  |
| Bloomberg                    | Solactive AG                                      | Bloomberg Euro Corporate Bond Index                                                                | AMUNDI EUR CORPORATE BOND                                         |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index                                   | AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG                       |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index                           | AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1-5Y HIGHEST RATED                    |
| Bloomberg                    | Solactive AG                                      | Bloomberg US Short Treasury Index                                                                  | AMUNDI US TREASURY BOND 0-1Y                                      |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index                                 | AMUNDI INDEX EURO AGG SRI                                         |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index                              | AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y                                       |
| 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 MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index                                         | AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI                                   |
| Bloomberg                    | Bloomberg Index Services Limited ("BISL")         | Bloomberg BioEnergy ESG-index                                                                      | AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED                              |
| Euronext                     | Euronext Paris SA                                 | CAC 40 ESG                                                                                         | AMUNDI CAC 40 ESG                                                 |
| Euronext                     | Euronext Paris SA                                 | MIB ESG Index                                                                                      | AMUNDI ITALY MIB ESG                                              |
| ICE Data Services, LLC       | ICE Data Services, LLC                            | NYSE Arca Gold BUGS Index                                                                          | AMUNDI NYSE ARCA GOLD BUGS                                        |
| J.P. Morgan                  | J.P. Morgan Securities LLC                        | J.P. Morgan Global Inflation 1-10 Year Tilted Index                                                | AMUNDI GLOBAL INFLATION-LINKED BOND SELECT                        |
| J.P. Morgan                  | J.P. Morgan Securities LLC                        | J.P. Morgan Government Bond Index Global (GBI Global)                                              | AMUNDI INDEX J.P. MORGAN GBI GLOBAL GOVIES                        |
| 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               |
| Markit                       | IHS Markit Benchmark Administration Limited       | Markit iBoxx USD Liquid Emerging Markets Sovereigns Index                                          | AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX                          |
| Markit                       | IHS Markit Benchmark Administration Limited       | iBoxx MSCI ESG EUR FRN Investment Grade Corporates TCA                                             | AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG                       |
| Markit                       | IHS Markit Benchmark Administration Limited       | iBoxx MSCI ESG EUR High Yield Corporates TCA                                                       | AMUNDI EURO HIGH YIELD BOND ESG                                   |
| Markit                       | IHS Markit Benchmark Administration Limited       | iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index                                                        | AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG                                         |
| Markit                       | IHS Markit Benchmark Administration Limited       | iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA                                             | AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG                       |
| Nasdaq                       | Nasdaq Copenhagen A/S                             | NASDAQ-100                                                                                         | AMUNDI NASDAQ-100                                                 |
| Nikkei                       | Tokyo Stock Exchange, Inc.                        | JPX-Nikkei 400                                                                                     | AMUNDI JPX-NIKKEI 400                                             |
| Russell                      | FRANK RUSSELL COMPANY ("Russell")                 | Russell 2000                                                                                       | AMUNDI RUSSELL 2000                                               |
| S&P                          | S&P Dow Jones Indices LLC                         | Dow Jones Switzerland Titans 30 Total Return Index                                                 | AMUNDI DJ SWITZERLAND TITANS 30                                   |
| S&P                          | S&P Dow Jones Indices LLC                         | S&P Global Luxury                                                                                  | AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY                                          |
| 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                         | 500 S&P                                                                                            | AMUNDI S&P 500                                                    |
| S&P                          | S&P Dow Jones Indices LLC                         | S&P 500 ESG+ Index                                                                                 | AMUNDI S&P 500 ESG                                                |
| S&P                          | S&P Dow Jones Indices LLC                         | S&P 500 Buyback                                                                                    | AMUNDI S&P 500 BUYBACK                                            |
| Scientific Beta              | ERI Scientific Beta                               | Scientific Beta Developed Multi-Beta Multi-Strategy Four-Factor ERC                                | AMUNDI INDEX EQUITY GLOBAL MULTI SMART ALLOCATION SCIENTIFIC BETA |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive GBS Developed Markets Europe Large & Mid Cap EUR                                         | AMUNDI PRIME EUROPE                                               |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive GBS Developed Markets Eurozone Large & Mid Cap Index                                     | AMUNDI PRIME EUROZONE                                             |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | F.A.Z. Index                                                                                       | AMUNDI F.A.Z. 100                                                 |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive Global Infrastructure Low Earnings Volatility                                            | AMUNDI GLOBAL INFRASTRUCTURE                                      |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive Eurozone Government Bond 0-1 Year Index                                                  | AMUNDI PRIME EURO GOV BONDS 0-1Y                                  |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive Smart Factory                                                                            | AMUNDI SMART FACTORY                                              |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive Bund Daily (-1x) Inverse Index                                                           | AMUNDI GERMAN BUND DAILY (-1X) INVERSE                            |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive GBS Emerging Markets Large & Mid Cap USD                                                 | AMUNDI PRIME EMERGING MARKETS                                     |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive Global Developed Government Bond                                                         | AMUNDI PRIME GLOBAL GOVERNMENT BOND                               |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive USD Investment Grade Corporate Index                                                     | AMUNDI PRIME US CORPORATES                                        |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive US Treasury Bond                                                                         | AMUNDI PRIME US TREASURY                                          |
| 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 United States Large & Mid Cap                                                        | AMUNDI PRIME USA                                                  |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive GBS Developed Markets Large & Mid Cap USD                                                | AMUNDI PRIME GLOBAL                                               |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive GBS Japan Large & Mid Cap                                                                | AMUNDI PRIME JAPAN                                                |
| Solactive                    | Solactive AG                                      | Solactive Eurozone Government Bond                                                                 | AMUNDI PRIME EURO GOVIES                                          |
| Stoxx                        | STOXX Limited                                     | SDAX Total Return Index                                                                            | AMUNDI SDAX                                                       |
| Stoxx                        | STOXX Limited                                     | EURO STOXX Select Dividend 30 (Net Return) EUR Index                                               | AMUNDI EURO STOXX SELECT DIVIDEND30                               |
| STOXX                        | STOXX Limited                                     | STOXX Europe 600 Index                                                                             | AMUNDI STOXX EUROPE 600                                           |
| STOXX                        | STOXX Limited                                     | DAX 50 ESG Index                                                                                   | AMUNDI DAX 50 ESG                                                 |

|       |               |                                       |                                        |
|-------|---------------|---------------------------------------|----------------------------------------|
| Stoxx | STOXX Limited | DivDAX Total Return Index             | AMUNDI DIVDAX                          |
| Stoxx | STOXX Limited | MDAX ESG+ (NR) EUR Index              | AMUNDI MDAX ESG                        |
| Stoxx | STOXX Limited | DAX INDEX                             | AMUNDI DAX                             |
| Stoxx | STOXX Limited | EURO STOXX 50                         | AMUNDI EURO STOXX 50                   |
| STOXX | STOXX Limited | SHORTDAX Index                        | AMUNDI SHORTDAX DAILY (-1X) INVERSE    |
| Stoxx | STOXX Limited | STOXX Europe 600 ESG+ Index           | Amundi Stoxx Europe 600 ESG            |
| STOXX | STOXX Limited | STOXX Europe Select Dividend 30 Index | Amundi Stoxx Europe Select Dividend 30 |

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 benchmarkförordningen. 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](http://amundi.com) och [amundietf.com](http://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](http://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 | Distribution |
| A                       | Alla investerare                                                                                                                                               | Nej                           | Ingen                                                                                                      | 5,50 %              | 1,00 % | 1,00 %    | 2,00 %      | 0,50 %         | Ingen        |
| A med specifika villkor | Se hemsidan <a href="http://www.amundi.lu/amundi-index-solutions">www.amundi.lu/amundi-index-solutions</a>                                                     | 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 <a href="http://www.amundi.lu/amundi-index-solutions">www.amundi.lu/amundi-index-solutions</a>                                                     | Ja                            | Se hemsidan <a href="http://www.amundi.lu/amundi-index-solutions">www.amundi.lu/amundi-index-solutions</a> | 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<br>Alla investerare på sekundärmarknaden                                                                                 | Nej                           | 1 000 000 USD<br>Ingen                                                                                     | 3,00 %              | 1,00 % | 3,00 %    | 1,00 %      | 0,40 %         | Ingen        |
| UCITS ETF 2             | Auktoriserad aktör på primärmarknaden<br>Alla investerare på sekundärmarknaden                                                                                 | Nej                           | 1 000 000 USD<br>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** är av två slag. 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 andelsklassens 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 andelsklassens 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".

**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. För den senaste informationen om tillgängliga andelsklasser, gå till [amundi.lu/amundi-index-solutions](http://amundi.lu/amundi-index-solutions) och/eller [amundi.etf.com](http://amundi.etf.com) eller begär en lista kostnadsfritt från det registrerade kontoret, se avsnittet "SICAV-fonden".



## 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 ombud istället för direkt i SICAV-fonden** Om du investerar genom en enhet eller som innehåller dina andelar under eget namn (ombudskonto) har denna enhet laglig rätt att utöva vissa rättigheter som är förknippade med dina andelar, såsom rösträtt. Om du vill behålla alla andelsägarrättigheter kan du investera direkt i SICAV-fonden. Tänk på att i vissa jurisdiktioner kan ett ombudskonto 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](http://amundi.com) och/eller [amundi.etf.com](http://amundi.etf.com)

Utdelning på utdelande andelar betalas ut enligt de bankkontouppgifter som vi har registrerat för ditt konto. För varje andelsklass 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

En delfond får emittera så lite som en tusendel av en andel (tre decimaler). 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 order via din förmedlare om det inte finns anledning att inte göra det.*

### PÅ PRIMÄRMARKNADEN

Den primära marknaden är den marknad på vilken andelar emitteras av SICAV-fonden och/eller löses in av SICAV-fonden.

Den primära marknaden för andelar/delfonder betecknade som "UCITS ETF" är i huvudsak relevant för de auktoriserade deltagarna i dessa ETF:er.

### INFORMATION SOM GÄLLER FÖR ALLA TRANSAKTIONER UTOM ÖVERLÅTELSE OCH TRANSAKTIONER PÅ SEKUNDÄRMARKNADEN

**Lägga order** 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 överföringsombud (se avsnittet "SICAV-fonden"). Order via fax är till sin natur föremål för överföringsfel, och vi kan inte vara ansvariga för faxorder 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.

För varje transaktion skickas ett bekräftelsemeddelande till den registrerade kontoinnehavaren.

**Bryttider och handläggningsschema** definieras 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.

**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.

**Utspänningsavgift** 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 utspänningsavgiften 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.

**Valutakonvertering** 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.

### 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.

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 avräkning, kan vi lösa in dina andelar, avbryta dess emission och returnera betalningen till dig, med avdrag för eventuella investeringsförluster och oförutsedda utgifter som uppstår vid annullering av de emitterade andelarna.

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 investering 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 överlåtelse 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 "beskrivningen 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.

## INLÖSEN AV AKTIER

*Se även "Information som gäller för alla transaktioner utom överlåtelse 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.

När du lagt en order om att köpa andelar, kan du endast dra tillbaka den om det uppstår ett handelsstopp för berörd delfond.

Observera att vi inte kommer att betala ut några inlösenintäkter förrän vi har fått all investerardokumentation från dig som vi kan anse vara nödvändig.

## 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 överlåtelse 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.

## 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 kommer offentliggöras 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 iakttagit 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 eventuellt likviditetsemission som påverkar delar av eller alla delar av indexet, vilket leder till att marknadsvärderingen stoppas.

Under sådana exceptionella fall då primärmarknaden öppnas 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 också att tillhandahålla nämnda förfarande till börsmarknadsoperatören 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 inlösenströsklarna, 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.

Substansvärdet anges alltid i andelsklassens utsedda valuta (och för vissa andelsklasser även i andra valutor) och beräknas med minst två decimaler. 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:

(tillgångar - skulder)

= substansvärde

antal utestående andelar

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 värdepapirspänning 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 utspänningseffekten för delfonden. Dessa justeringar försöker återspegla de faktiska kurserna på de underliggande transaktionerna, baserat på uppskattade handelsspreadar, kostnader och andra marknads- och handelsöverväganden, i enlighet med den interna process som finns på plats hos förvaltningsbolaget. Substansvärdet justeras uppåt vid ett nettointflöde 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](http://www.amundi.lu/amundi-index-solutions). Om en delvis swingprissättning tillämpas gäller en sådan justering lika för all teckning och inlösen denna transaktionsdag, när nettointflöden/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 "Utspänningsavgift" 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.** Värdet 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 fondföretags-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 SOM BETALAS FRÅN DELFONDENS TILLGÅNGAR

**Taxe d'abonnement** SICAV-fonden omfattas vanligtvis av 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.

För delfonder som förvaltas aktivt är SICAV-fonden i Luxemburg skyldig att betala en taxe d'abonnement på 0,05 % per år. Denna årliga skatt sänks dock till 0,01 % per år för delfonder och andelar som är förbehållna institutionella andelsägare.

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.

Även om ovanstående skatteinformation är korrekt enligt styrelsens kännedom, är det möjligt att en skattemyndighet kan införa nya skatter (inklusive retroaktiva skatter).

### 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 01 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 1 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 köpa 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.
- **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 inkluderar 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 registratören 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 prenumererar via en mellanhand och/eller förvaltare som investerar för din räkning, tillämpas förstärkta aktsamhetsåtgärder i enlighet med gällande lagar och förordningar, för att analysera robustheten hos AML/CFT-kontrollramen hos mellanhanden/förvaltaren.

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.

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 andelsägarna. 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 andelsägars 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 sparanddirektiv, 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, registratören 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 tillgång till sina personuppgifter
- 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 köpvärd 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 09 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 05 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

den 30 september 2016

den 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 Luxembourg

Nicolas Vauléon

Chief Executive Officer

Amundi Global Servicing

5, Allée Scheffer, L-2520 Luxembourg

Alan Guy

Head of Cross Border Product & Innovation

Amundi Irland

1 Georges Quay Plaza

Dublin 2 Dublin, Irland

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

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 09 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 registrartjänster. 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 registratören.

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

PricewaterhouseCoopers, Société Coopérative

2 rue Gerhard Mercator

B.P. 1443 L-1014 Luxembourg

Revisorn, en "réviseur 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 Luxembourg 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 beslutsförfarande. När inget beslutsförfarande 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

*Den 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,
- ståtliga, 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
- standardmäklari- 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

### PUBLICIERING 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](http://finesti.com)

Information om tidigare resultat finns i faktabladet eller i det relevanta avsnittet "Tidigare resultat" på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) 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](http://amundi.com) och/eller [amundi.lu](http://amundi.lu), 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 vad styrelsen anser vara 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).

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 företrädare 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 röstkvalitet). 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 företrädare vid stämman, eller med 25 % av de andelar som är närvarande och företrädare 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 företrädare vid en andelsstämma.

Bolagsstämman, som fattar beslut med enkel majoritet av de avgivna rösterna av andelsägare som är närvarande eller företrädare 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 godkänner.

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 företrädde 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 KLASSE(R)

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 Luxembourg  
Tfn +352 26 86 80 80  
Fax +352 26 86 80 99

### Juridisk företagsform

Société Anonyme

### Stiftat

den 20 december 1996

### Bolagsordning

Den första trädde ikraft den 20 december 1996 och publicerades i Mémorial den 28 januari 1997. Senast ändrad den 01 januari 2018 och publicerad i RESA den 08 januari 2018.

### Tillsynsmyndighet

Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF).  
283, route d'Arlon  
L-1150 Luxembourg

### 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 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 kvartalsvis i efterskott. 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  
Deputy Head of Operations, Services & Technology Division  
Amundi Ireland Ltd

Enrico Turchi  
Verkställande direktör  
Amundi Luxembourg S.A.

*Styrelseledamot 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.

Enrico Turchi  
Managing Director/Deputy Chief Executive Officer  
Amundi Luxembourg S.A.

Pierre Bosio  
Chief Operating Officer  
Amundi Luxembourg S.A.

Charles Giraldez  
Deputy Chief Executive Officer  
Amundi Luxembourg S.A.

Benjamin Launay  
Fastighetsportföljförvaltare  
Amundi Luxembourg S.A.

Loredana Carletti  
Head of Amundi Real Assets Luxembourg  
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

Administrationsombudet ansvarar för vissa administrativa tjänster som det blivit delegerat, inklusive beräkning av substansvärden och hjälp med utarbetandet och inlämnandet av finansiella rapporter.

### REGISTRATOR, ÖVERFÖRINGS- OCH BETALNINGSOMBUD

CACEIS Bank, Luxemburgfilialen.  
5, Allée Scheffer, L-2520 Luxemburg

Registratorn och överföringsombudet ansvarar för att upprätthålla SICAV-fondens andelsägarregister och för att behandla förfrågningar om att emittera, köpa, sälja, lösa in, byta eller överlåta andelar i delfonder.

## Bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI GLOBAL AGG SRI 1-5

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800KMRNQ4SR4RKX08

## 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 % 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). 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).

● ***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 Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral 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](https://www.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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year Sustainable SRI Sector Neutral Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

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

risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

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.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 1-5 Year 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" 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](https://www.bloomberg.com/indices) 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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.



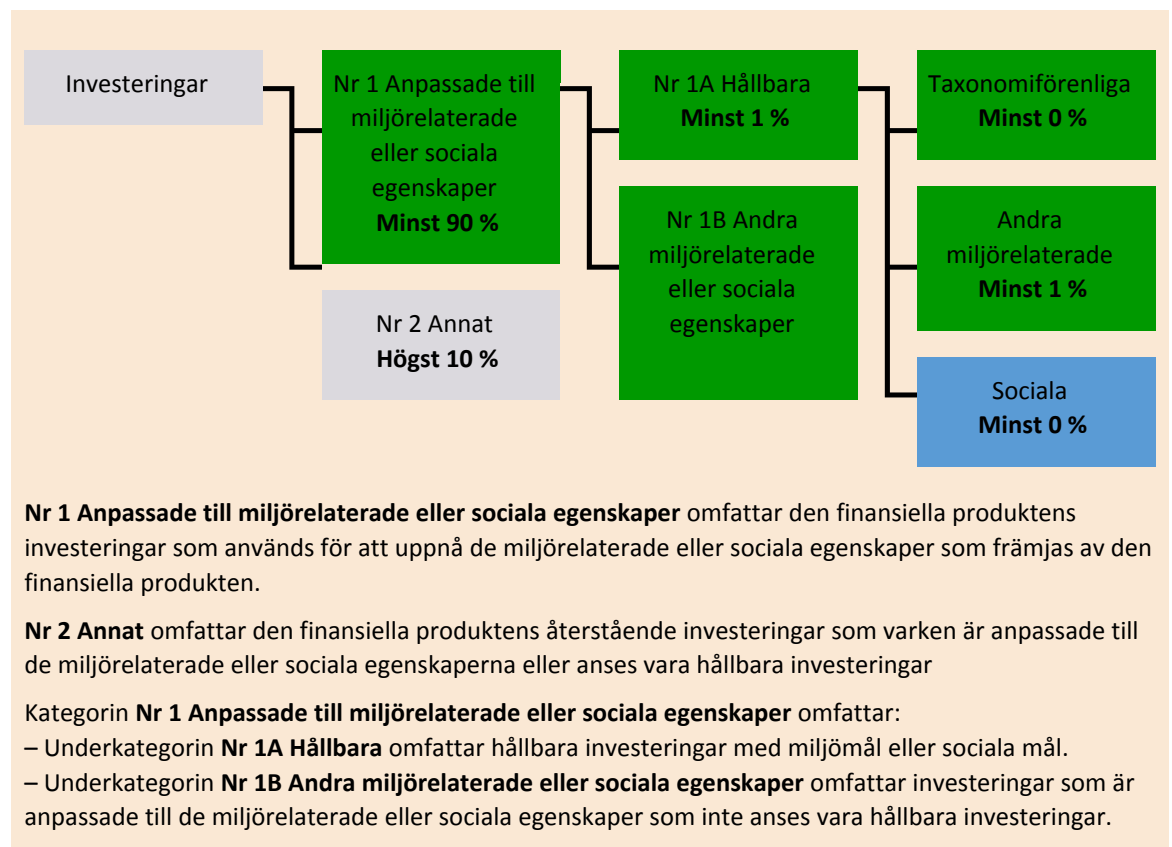
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

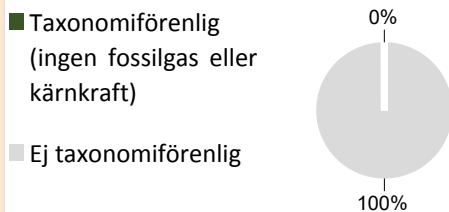
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

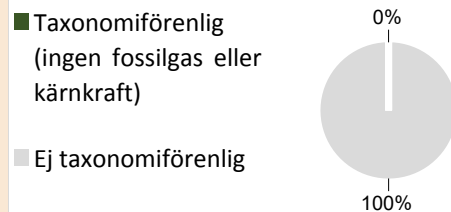
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 39 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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](http://www.amundietf.com).



15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI EUR SHORT TERM HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG 2138001B51SCUCTAZU58

Identifieringskod för juridiska personer:

## 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 % 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).

### **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](http://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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

☐ Nej



## 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.

**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 förvaltnad 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

**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

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](http://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.

### ● ***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.





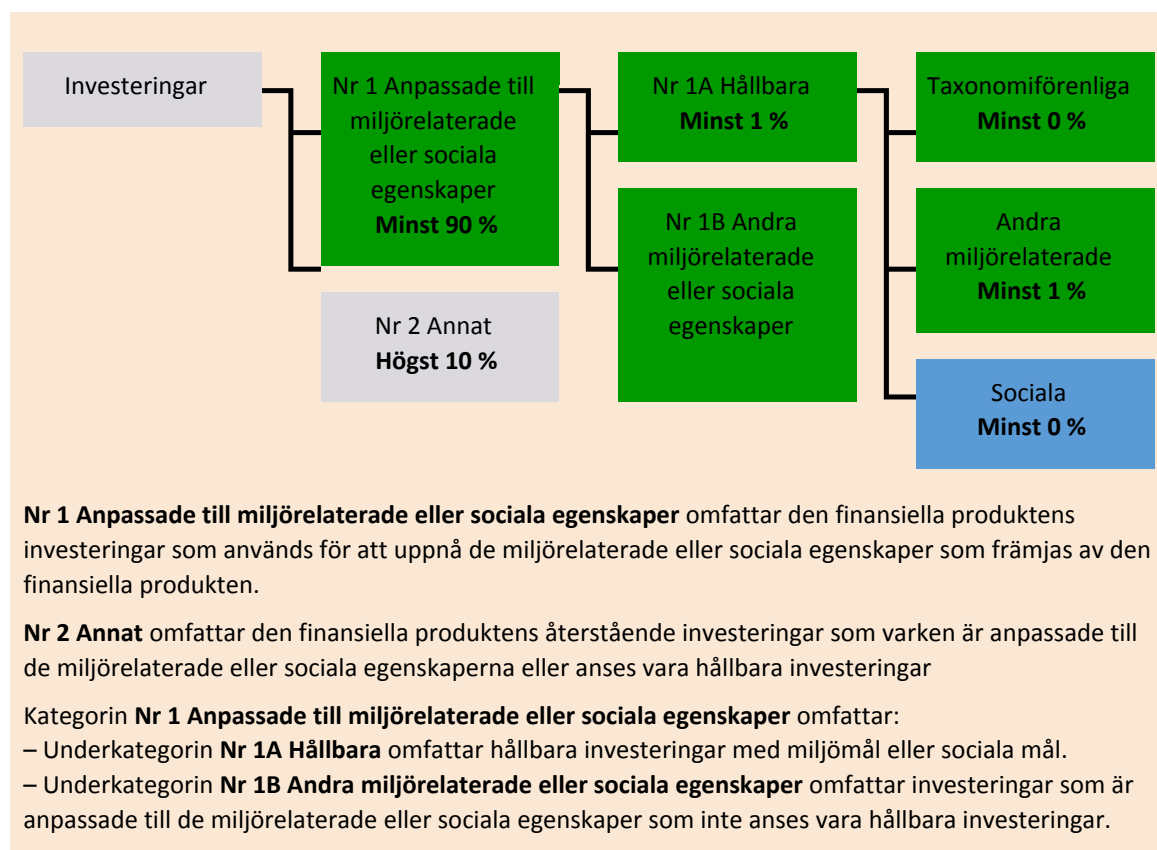
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

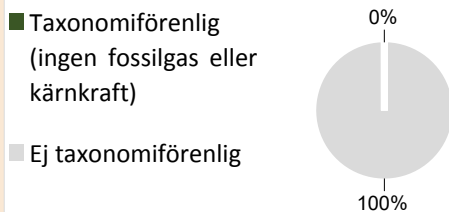
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

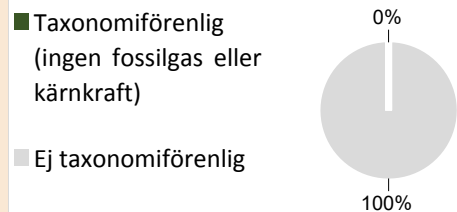
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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 företagsemitter 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.markit.com/Documentation/Product/Iboxx>



**Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**

Mer information om delfonden finns på [www.amundietf.com](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT

#### Identifieringskod för juridiska personer:

2138005S5JAYPLESDA45

## 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 % 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 en metod med olika vikter:

- vikten för företagen med bäst ESG-betyg kommer generellt sett att vara högre.
- vikten för företagen med sämst ESG-betyg kommer generellt sett att vara lägre.

### ● 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 definieras MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT Index ("indexet") genom att utesluta värdepapper från moderindexets investeringsområde utifrån följande kriterier:

1. Företag som saknar kreditbetyg; företag som inte har utvärderats eller betygsatts av MSCI grundat på deras ESG-meriter
2. Företag som enligt denna metod har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor under de senaste tre åren
3. Företag som är inblandade i verksamhet gällande kontroversiella vapen, så som definierat enligt metoden för MSCI Ex-Controversial Weapons Indexes
4. Företag som sysslar med produktion av kol avsett att användas i värmekraftverk eller tobaksproduktion. Varje företag i det godtagbara investeringsområdet tilldelas ett kombinerat ESG-betyg, som beräknas med:

(i) aktuella ESG-betyg för värdepapper som ingår i MSCI och

(ii) det ESG-betyg som definieras som förändringen av värdepapperens ESG-betyg över tid.

Detta kombinerade ESG-betyg tillämpas sedan för att omvika de godtagbara värdepapperen 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](http://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. 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 "presterar bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presterar bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presterar 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade

- ***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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. investeringsobjektets 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-taxonomin måls, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU Index ("moderindexet") och som är representativt för värdepapper från stora och medelstora företag i 10 utvecklade länder i europeiska ekonomiska och monetära unionen.

Indexet syftar till att representera resultatet av en strategi som ökar exponeringen jämfört med moderindexet för företag med både en robust ESG-profil samt en positiv tendens att förbättra den ESG-profilen.

Metoden syftar till att justera beståndsdelarna för viktningen av "fritt omsättbara aktier" baserat på vissa mått av miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG").

● **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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT Index ("indexet") definieras genom att utesluta värdepapper från moderindexets investeringsområde utifrån följande kriterier:

1. Företag som saknar kreditbetyg; företag som inte har utvärderats eller betygats av MSCI grundat

på deras ESG-meriter

2. Företag som enligt denna metod har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor under de senaste tre åren

3. Företag som är inblandade i verksamhet gällande kontroversiella vapen, så som definierat enligt metoden för MSCI Ex-Controversial Weapons Indexes

4. Företag som sysslar med produktion av kol avsett att användas i värmekraftverk eller tobaksproduktion. Varje företag i det godtagbara investeringsområdet tilldelas ett kombinerat ESG-betyg, som beräknas med:

(i) aktuella ESG-betyg för värdepapper som ingår i MSCI och

(ii) det ESG-betyg som definieras som förändringen av värdepapperens ESG-betyg över tid.

Detta kombinerade ESG-betyg tillämpas sedan för att omvika de godtagbara värdepapperen i indexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

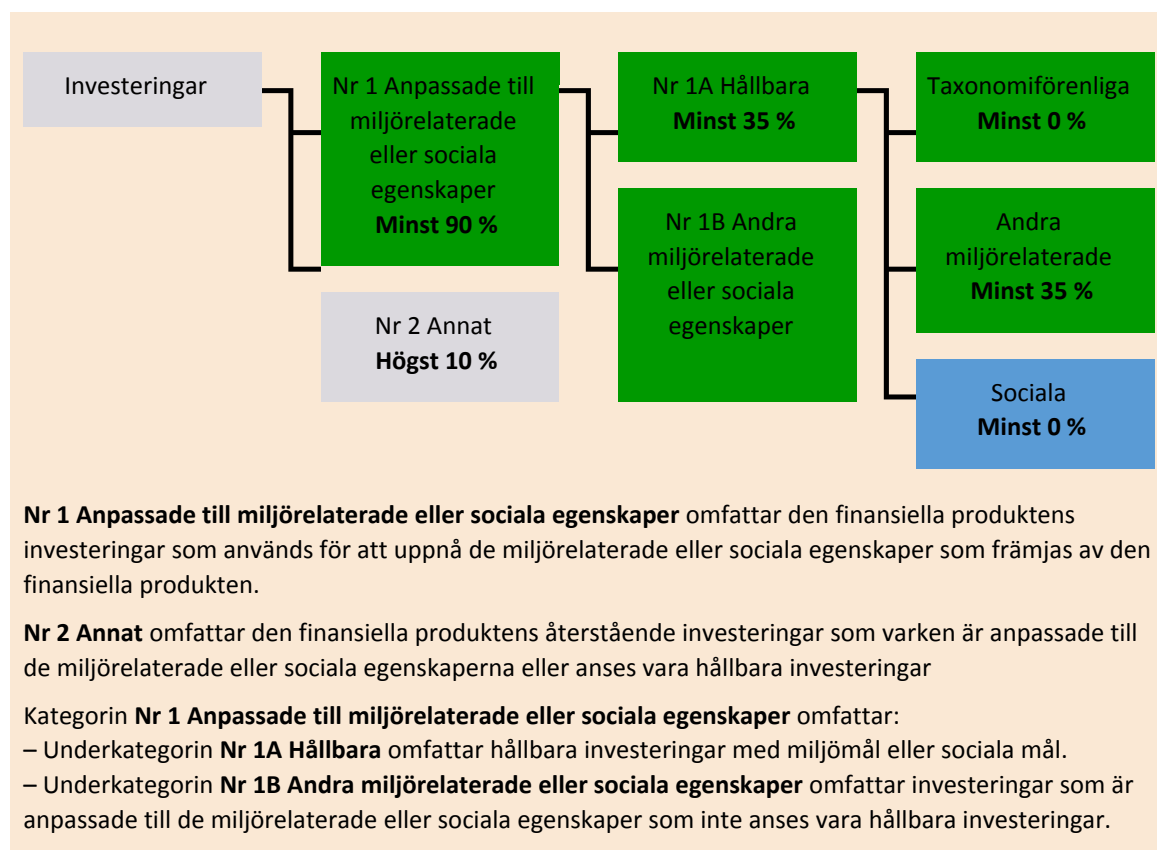
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 35 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

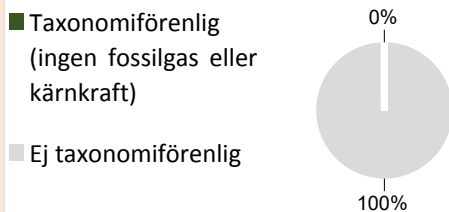
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

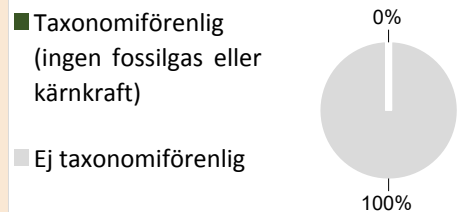
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EMU ESG UNIVERSAL SELECT är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU Index ("moderindexet") och som är representativt för värdepapper från stora och medelstora företag i 10 utvecklade länder i europeiska ekonomiska och monetära unionen.

Indexet syftar till att representera resultatet av en strategi som ökar exponeringen jämfört med moderindexet för företag med både en robust ESG-profil samt en positiv tendens att förbättra den ESG-profilen.

Metoden syftar till att justera beståndsdelarna för viktningen av "fritt omsättbara aktier" baserat på vissa mått av miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG").

● ***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](http://www.amundietf.com).

### **Ansvarsfriskrivning**

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS SELECT

#### 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 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 % 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). 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).

● ***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 Leaders Select 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 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 det överordnade 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaltrade 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin må, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index 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. Delfonden följer resultatet för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

indexets resultat.

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index 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.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index ("indexet") omfattar alla värdepapper i det överordnade indexet.

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 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 det överordnade indexet.

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?***

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



### Tillgångsallokering

beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

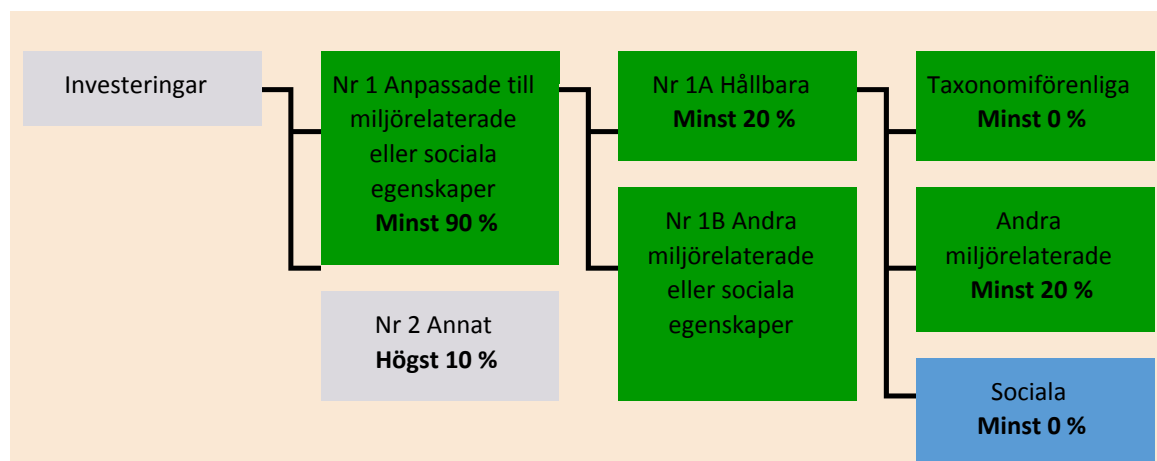
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

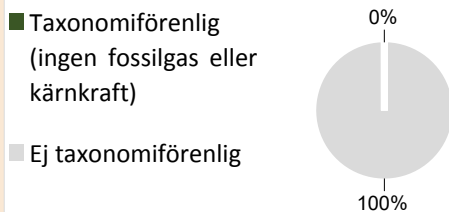
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

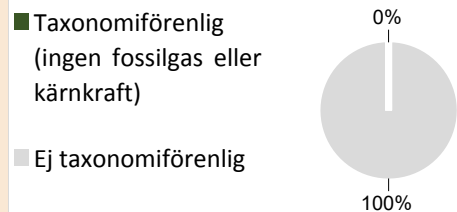
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index 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.

● ***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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING ESG BROAD CTB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800T33RUUA8EO4L57

## 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 % 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 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.

### **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<sub>2</sub>) 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 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 borrhning 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i moderindexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 1 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

### **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](http://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 förvaltrade 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. 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 "presterar bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presterar bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presterar 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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade,

- ***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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

Bli rentvård 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-taxonomin måls, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används,

se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

#### 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.

MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging markets Index ("överordnat index"), som motsvarar marknader för stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021). Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg.

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).

● ***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 förvaltd 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 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 borrhning 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i moderindexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 1 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

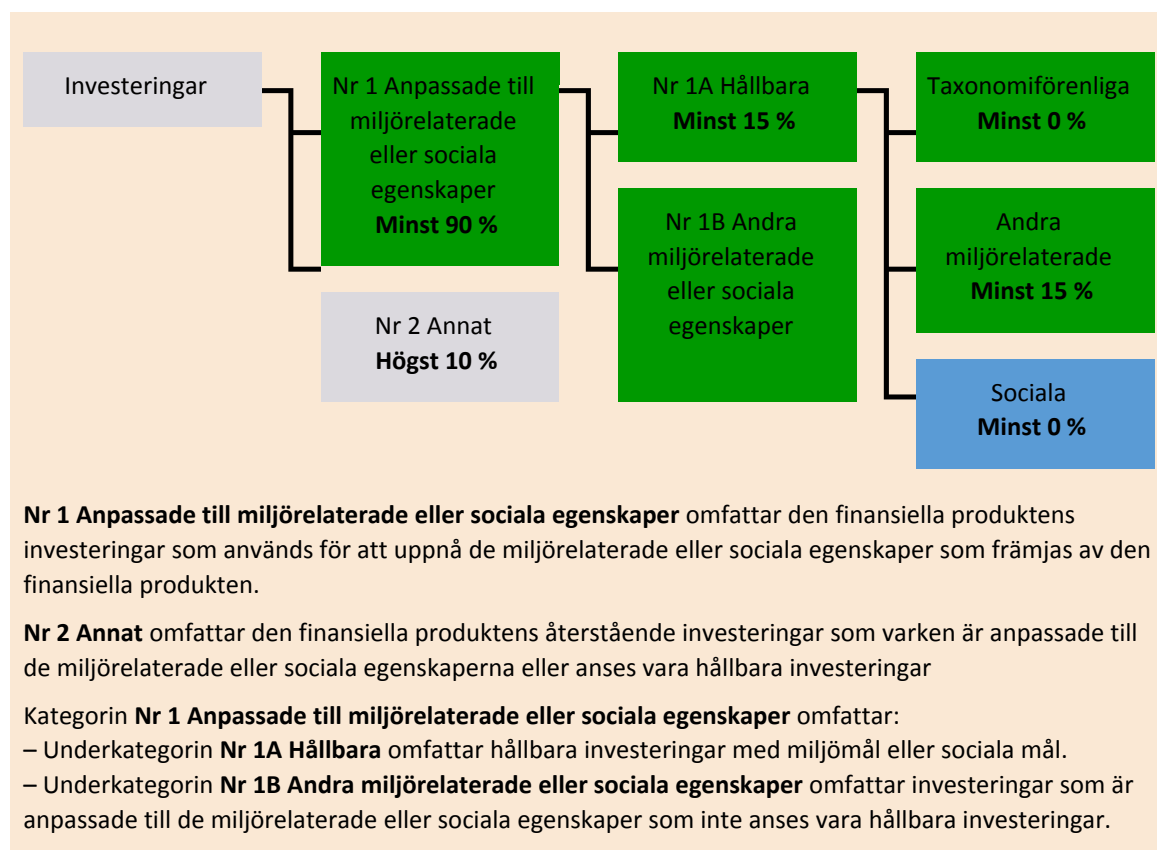
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

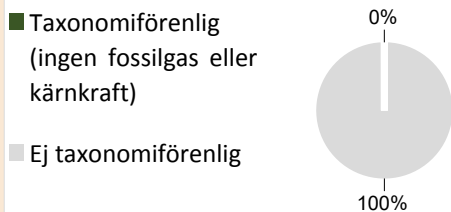
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

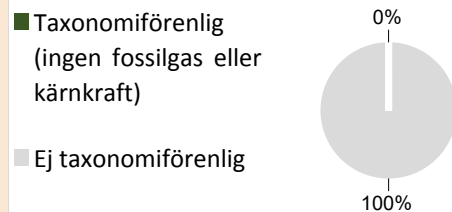
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Emerging Markets ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging markets Index ("överordnat index"), som motsvarar marknader för stora och medelstora företag i 27 tillväxtländer (per november 2021). Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).

Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI EUR FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG

#### Identifieringskod för juridiska personer:

5493006D311IM3Q4K364

## 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 % 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). 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).

● ***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](https://www.bloombergindices.com) för mer information om

● ***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](http://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. 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

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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

 Nej



### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## 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.

### ● 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 förvaltd 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](https://www.bloomberg.com/indices) 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.

### ● 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

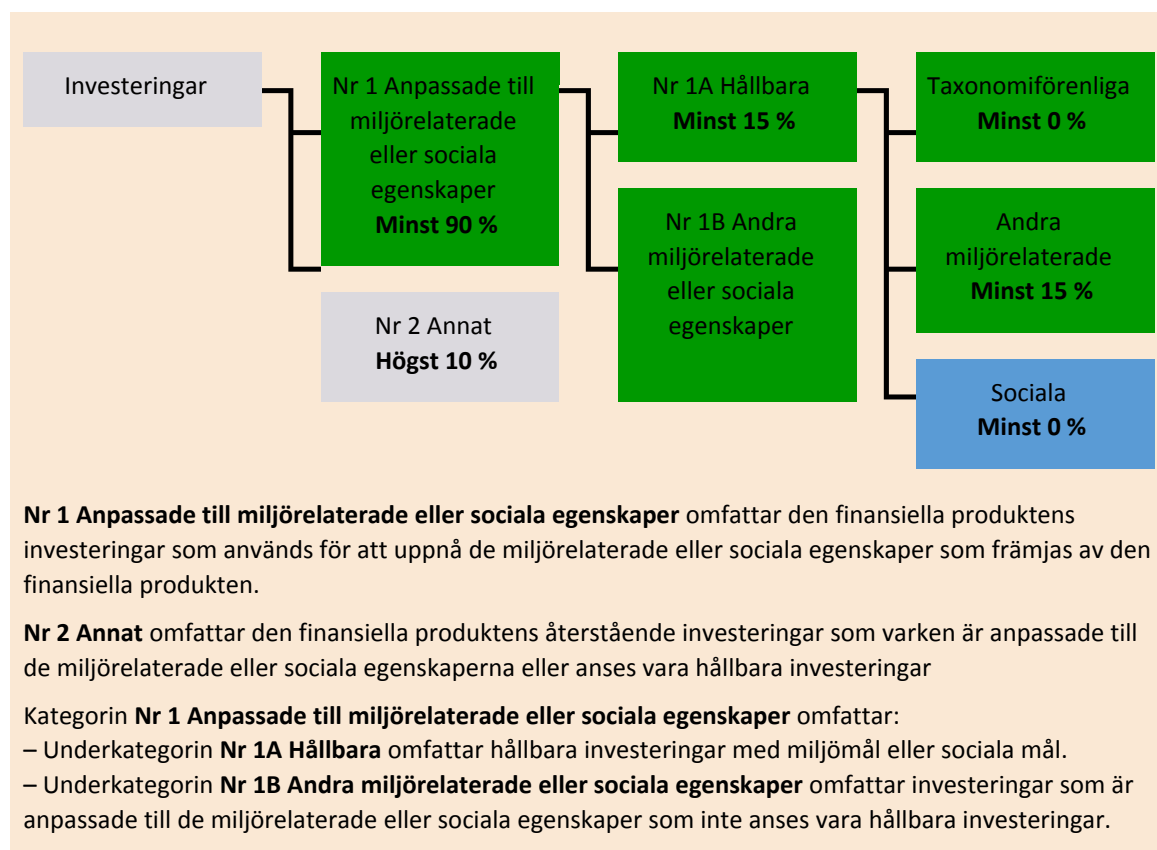
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

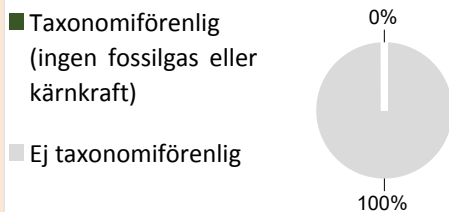
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

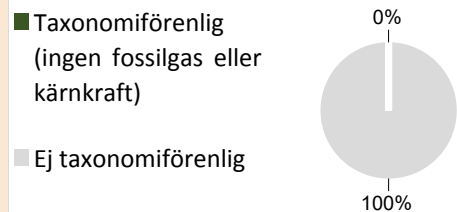
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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](http://www.amundietf.com).

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI DAX 50 ESG

**Identifieringskod för juridiska personer:**

213800TB2ROJ7LC3AT12

## 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 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 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.

**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 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=EAlaIQobChMllv6qz6f5-wIVRbLVCh2X6wdGEAAAYASAAEgLu9vD\\_BwE](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=EAlaIQobChMllv6qz6f5-wIVRbLVCh2X6wdGEAAAYASAAEgLu9vD_BwE)

Närmare bestämt har DAX 50 ESG Index ("indexet") satts samman utifrån alla aktier som ingår i HDAX Index. Sedan tillämpas följande filter:

- Företag som bedöms inte vara kvalificerade baserat på Sustainalytics Global Standards Screening utesluts.
- Företag som enligt Sustainalytics är aktiva i branscher för kontroversiella vapen, militärkontrakt, tobak, kärnkraft och kol är inte valbara.

Indexet väljer sedan de 50 största och mest likvida värdepapperen baserat på kvantitativa kriterier, närmare bestämt fritt omsättningsbart börsvärde, orderboksvolymen och Sustainalytics ESG-riskbetyg.

### **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](http://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 förvaltrade 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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. investeringsobjektets 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:



Det första testfiltret 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-taxonominns 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för DAX 50 ESG Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

DAX 50 ESG följer resultatet för de 50 största aktierna med jämförbart goda resultat baserat på deras miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier. Indexet utgörs av värdepapper som ingår i HDAX index som är representativt för stora och mellanstora bolag handlade på den tyska aktiemarknaden och har juridiskt säte eller verksamhetssäte i Tyskland.

HDAX består av de bolag som ingår i DAX (tyskt index för stora tyska bolag som följer resultatet för de 40 största bolagen på den tyska aktiemarknaden baserat på börsvärde och omsättning), MDAX (som består av de 50 bolag som kommer efter de bolag som ingår i DAX baserat på börsvärde och omsättning) och TecDAX (som består av de 30 största och mest likvida teknikvärdepapperen baserat på börsvärde och omsättning).

#### ● 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

DAX 50 ESG Index ("indexet") har satts samman utifrån alla aktier som ingår i HDAX Index. Sedan tillämpas följande filter:

- Företag som bedöms inte vara kvalificerade baserat på Sustainalytics Global Standards Screening utesluts.
- Företag som enligt Sustainalytics är aktiva i branscher för kontroversiella vapen, militärkontrakt, tobak, kärnkraft och kol är inte valbara.

Indexet väljer sedan de 50 största och mest likvida värdepapperen baserat på kvantitativa kriterier, närmare bestämt fritt omsättningsbart börsvärde, orderboksvolymen och Sustainalytics ESG-riskbetyg.

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?***

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

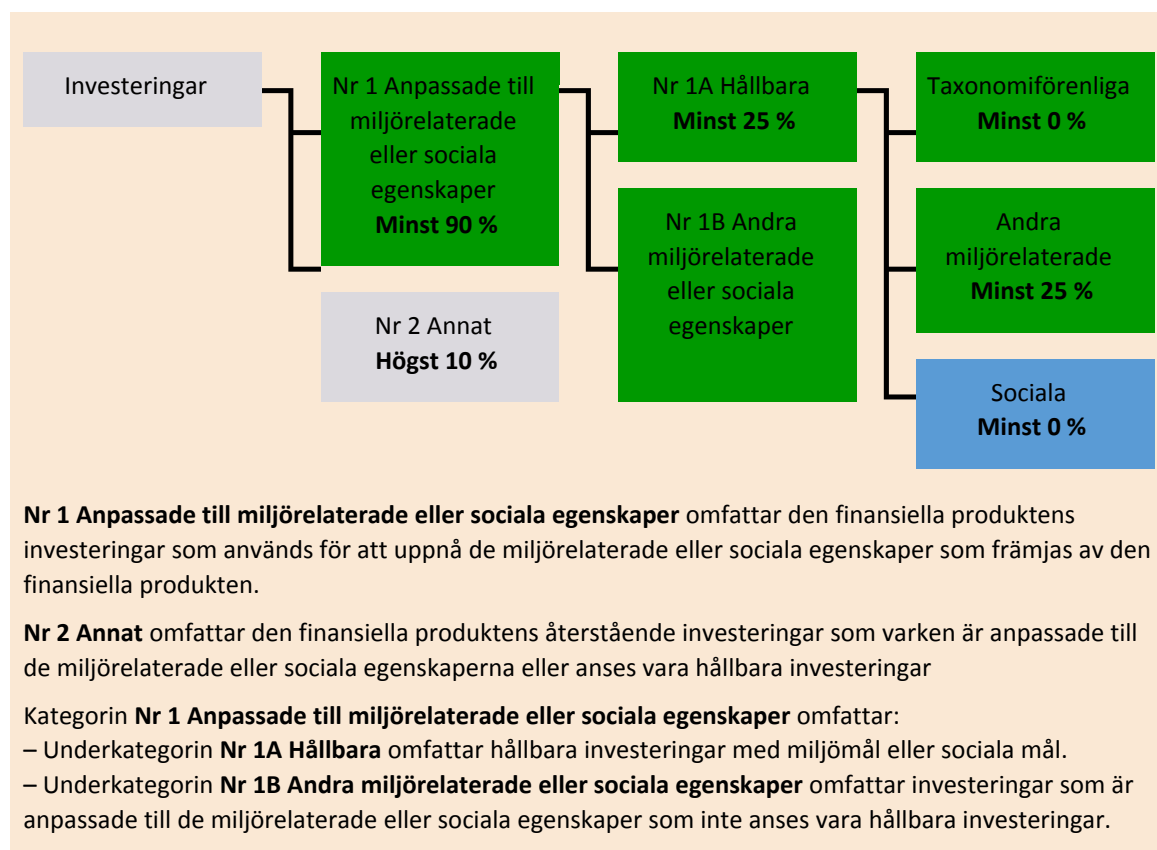
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 25 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

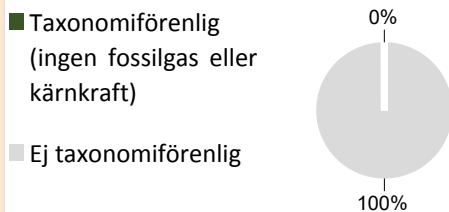
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

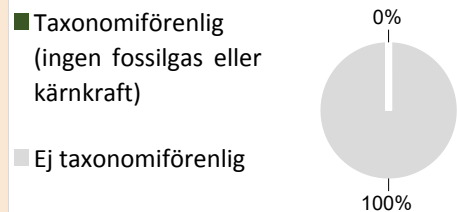
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

DAX 50 ESG följer resultatet för de 50 största aktierna med jämförbart goda resultat baserat på deras miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier. Indexet utgörs av värdepapper som ingår i HDAX index som är representativt för stora och mellanstora bolag handlade på den tyska aktiemarknaden och har juridiskt säte eller verksamhetssäte i Tyskland.

HDAX består av de bolag som ingår i DAX (tyskt index för stora tyska bolag som följer resultatet för de 40 största bolagen på den tyska aktiemarknaden baserat på börsvärde och omsättning), MDAX (som består av de 50 bolag som kommer efter de bolag som ingår i DAX baserat på börsvärde och omsättning) och TecDAX (som består av de 30 största och mest likvida teknikvärdepapperen baserat på börsvärde och omsättning).

#### ***Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?***

Mer information om indexet finns på <https://www.dax-indices.com/ressourcen#guides>



### **Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**



Mer information om delfonden finns på [www.amundietf.com](http://www.amundietf.com).

### Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### 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 % 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). 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).

● ***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 [bloombergingredients.com](https://www.bloombergingredients.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](https://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 förvaltrade 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. 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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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. investeringsobjektets 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. investeringsobjektets 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

Bli rentvård 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-taxonominns 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

 Nej





### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## 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 företagsemitter som följer reglerna i iBoxx EUR High Yield TCA Index ("moderindexet") och tillämpar ESG-kriterier i urvalet av kvalificerade värdepapper.

### ● **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.

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](https://www.bloomberg.com/indices) för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet

Detta är en passivt förvaltd 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 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](https://www.bloomberg.com/indices) 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.

● ***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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

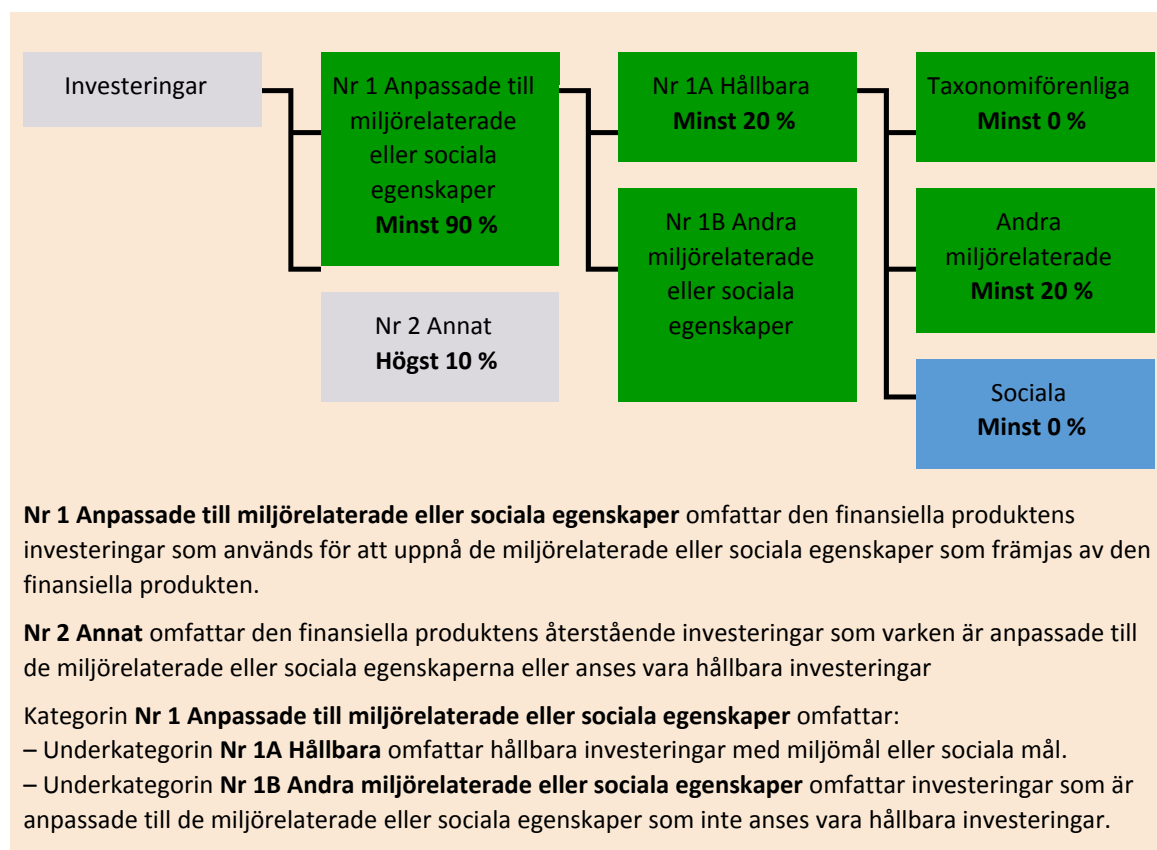
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

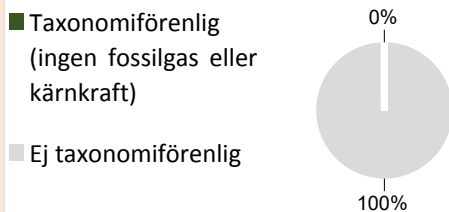
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

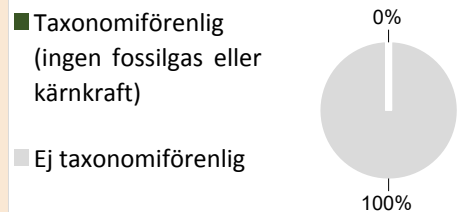
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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 företagsemitter 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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI EUROPE SMALL CAP ESG CLIMATE NET ZERO213800H5N4JH1FRBT766  
AMBITION CTB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

## 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 % 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 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.

### **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<sub>2</sub>) 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 att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka MSCI 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 affärsverksamheter som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrhning 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 det överordnade indexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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](http://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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin måls, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### 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.

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Small Cap Index ("överordnat index"), representativt värdepapper för små bolag på utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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).

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index sammansätts genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka MSCI ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB) samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet.

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 borrhning 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 det överordnade indexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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:

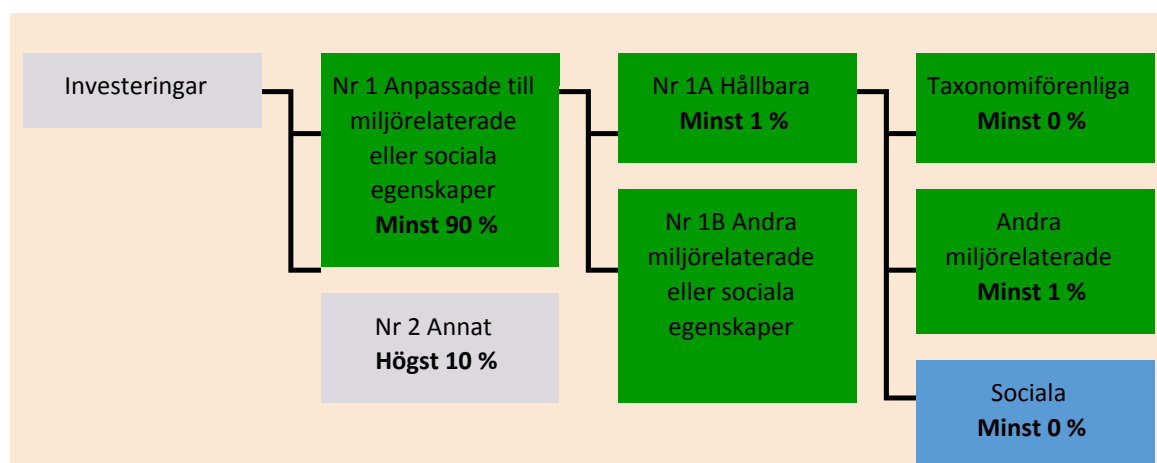
- **omsättning**, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

## Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar. Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

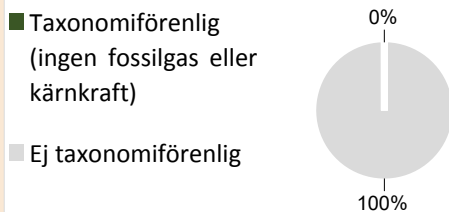
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

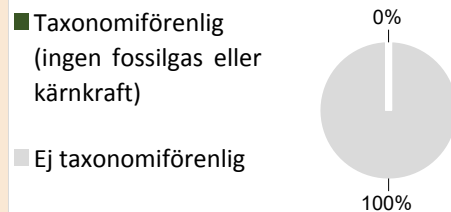
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Small Cap Index ("överordnat index"), representativt värdepapper för små bolag på utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg.

Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

**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**

Gäller från den 02.02.2024

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI MSCI EUROPE PAB NET ZERO AMBITION

**Identifieringskod för juridiska personer:**

2221005CN7A7XZRQ4W36

## 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 % 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 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.

**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<sub>2</sub>) dividerat med företagsvärdet inklusive konstanter.

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 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, elproduktion och vapen baserade 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. Lägsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med det överordnade indexet.

b. Lägsta 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 det överordnade indexets.

d. Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i det överordnade indexet.

e. Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till det överordnade indexet.

f. Ökning av sammanlagt klimat-VaR under 1,5-gradersscenariot och jämfört med det överordnade indexet. MSCI:s mått på klimat-VaR hjälper investerare att bedöma framtida kostnader relaterade till klimatförändringar och förstå vad dessa framtida kostnader kan innebära vid den aktuella värderingen av värdepapper.

g. Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande till det överordnade indexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:

a. Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till det överordnade indexet.

b. Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter/viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen i förhållande till det överordnade indexet.

c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till det överordnade indexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdelens aktiva vikt, beståndsdelens 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](http://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. 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 "presterar bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presterar bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presterar 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](http://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

- ***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?***



investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonominns 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Europe Climate Paris Aligned Filtered Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered 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 ("det överordnade indexet"). 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.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered 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, elproduktion och vapen baserade 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. Lägsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med det överordnade indexet.
- b. Lägsta 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 det överordnade indexets.
- d. Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i det överordnade indexet.
- e. Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till det överordnade indexet.
- f. Ökning av sammanlagt klimat-VaR under 1,5-gradersscenariot och jämfört med det överordnade indexet. MSCI:s mått på klimat-VaR hjälper investerare att bedöma framtida kostnader relaterade till klimatförändringar och förstå vad dessa framtida kostnader kan innebära vid den aktuella värderingen av värdepapper.
- g. Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande till det överordnade indexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:

- a. Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till det överordnade indexet.
- b. Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter/viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen i förhållande till det överordnade indexet.
- c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till det överordnade indexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdelens aktiva vikt, beståndsdelens 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](https://www.msci.com).

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?**

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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.



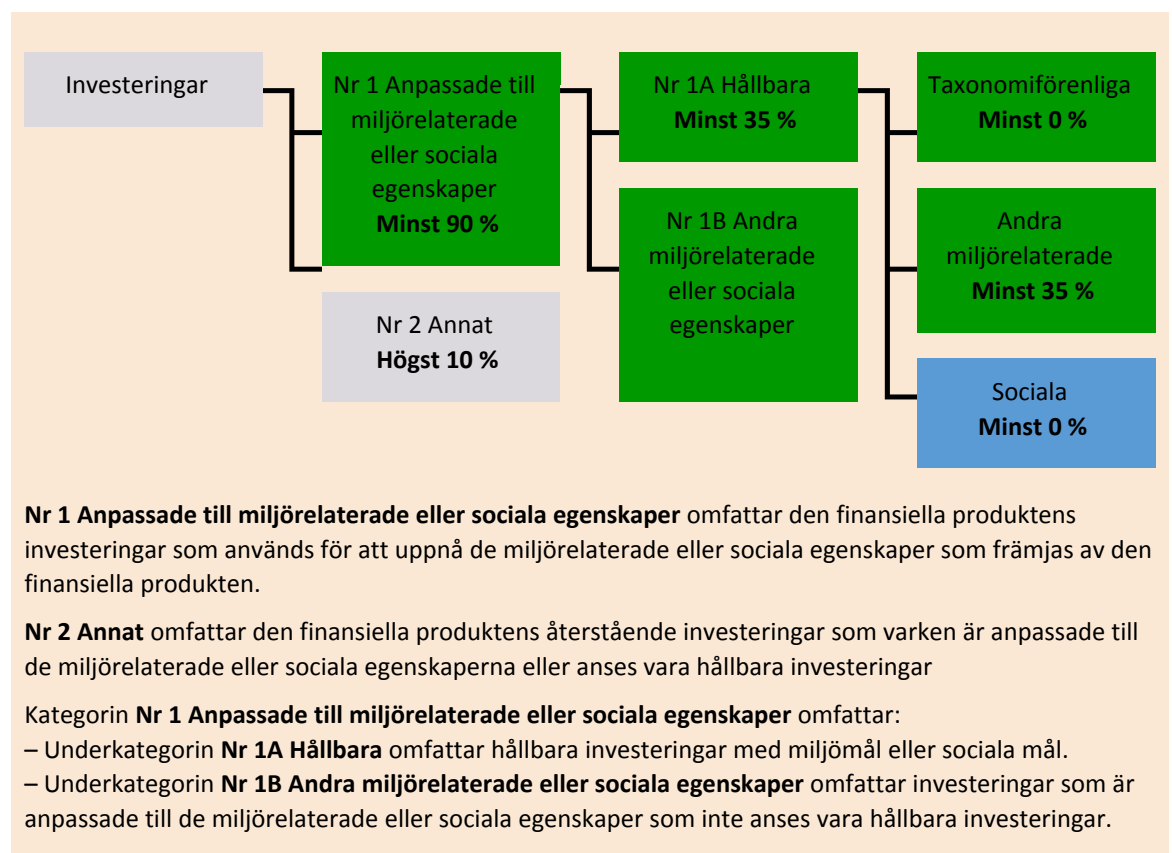
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 35 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

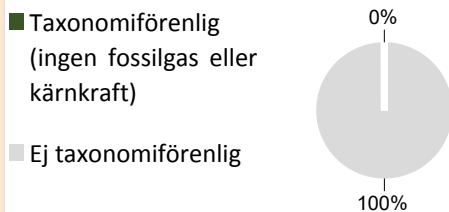
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

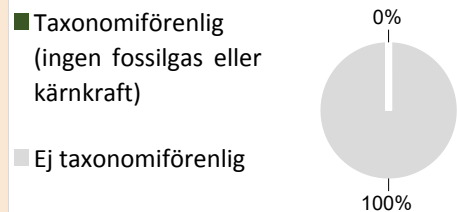
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EUROPE Climate Paris Aligned Filtered Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe Index ("det överordnade indexet"), 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](http://www.amundietf.com).



Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI US AGG SRI

Identifieringskod för juridiska personer:

213800MEFG6O5JHBKE31

## 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 % 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).

### **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 inkluderar Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index prioriterade och efterställda statsobligationer, statsrelaterade obligationer och företagsobligationer med minst ett års återstående löptid, oavsett optionalitet. Dessutom måste kapital och ränta vara denominerade i US-dollar med ett lägsta utestående nominellt belopp på 500 miljoner US-dollar. Sedan tillämpas följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara och emittenter utan betyg från sektorer med betyg utesluts. MSCI ESG-betyg uppdateras i allmänhet årligen, men kan ses över oftare vid behov
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. Emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg (vilket motsvarar noll), som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts. \*Se indexmetoden som finns på [bloombergindices.com](https://www.bloomberg.com/indices) för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet.  
\*Se indexmetoden som finns på [bloombergindices.com](https://www.bloomberg.com/indices) 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index följer skuldförbindelser med fast ränta, höga kreditbetyg och ett utestående nominellt belopp på minst 500 miljoner US-dollar. Detta index är baserat på US Aggregate ex Securitized 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 eftersom de är oförenliga med vissa värderingsbaserade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg. Dessutom viktas marknaden för de tre sektorerna (stater, statsrelaterat och företag) om för att stämma överens med vikterna för dessa tre sektorer i US Aggregate ex Securitized Index.

### ● 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index inkluderar prioriterade och efterställda statsobligationer, statsrelaterade obligationer och företagsobligationer med minst ett års återstående löptid, oavsett optionalitet. Dessutom måste kapital och ränta vara denominerade i US-dollar med ett lägsta utestående nominellt belopp på 500 miljoner US-dollar. Sedan tillämpas följande filter:

1. Värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre för att vara godtagbara och emittenter utan betyg från sektorer med betyg utesluts. MSCI ESG-betyg uppdateras i allmänhet årligen, men kan ses över oftare vid behov
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. Emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg (vilket motsvarar noll), som mäter emittenters inblandning i större ESG-kontroverser och hur väl de följer internationella normer och principer, utesluts.

\*Se indexmetoden som finns på [bloombergindices.com](http://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.

● ***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.





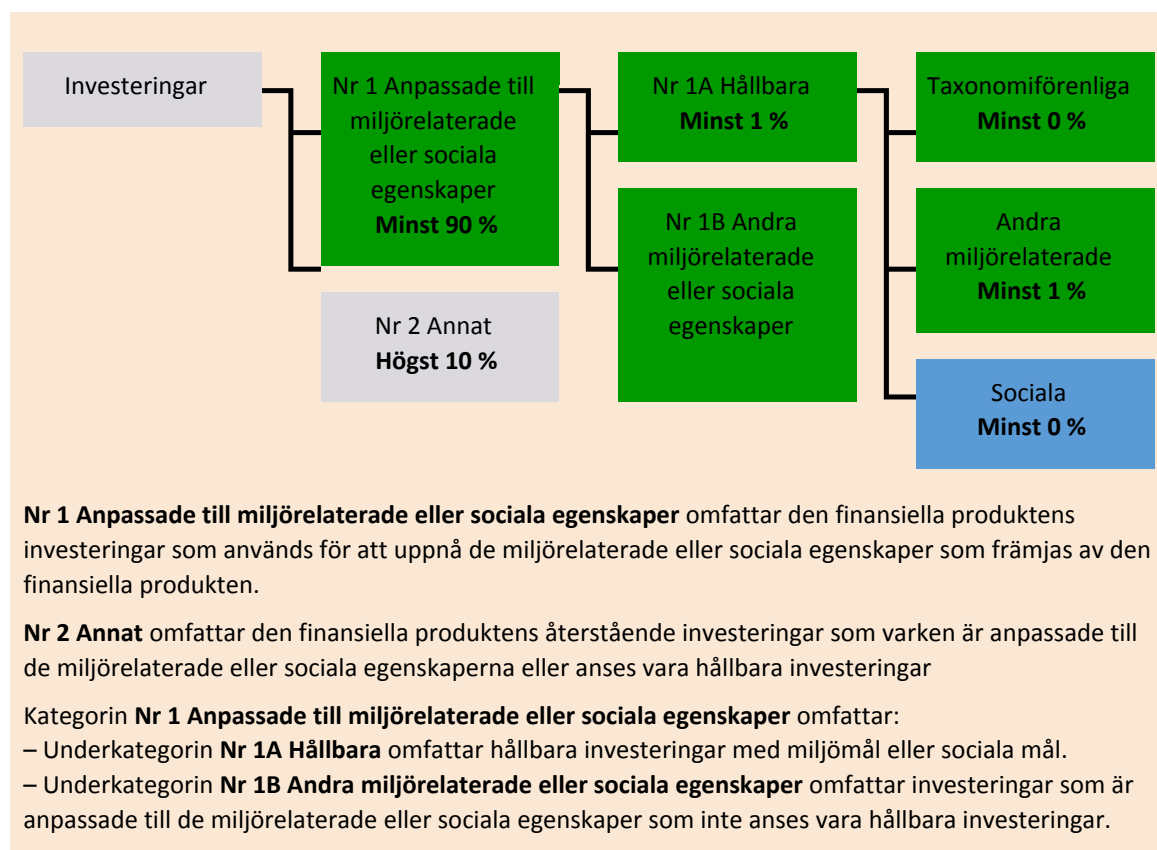
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

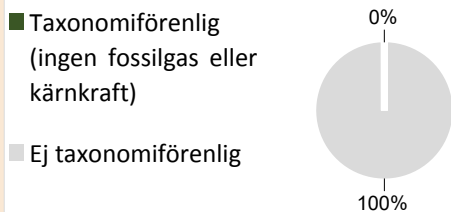
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

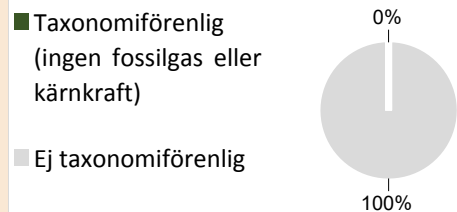
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 61 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

Bloomberg MSCI US Aggregate ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index följer skuldförbindelser med fast ränta, höga kreditbetyg och ett utestående nominellt belopp på minst 500 miljoner US-dollar. Detta index är baserat på US Aggregate ex Securitized 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 eftersom de är oförenliga med vissa värderingsbaserade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg. Dessutom viktas marknaden för de tre sektorerna (stater, statsrelaterat och företag) om för att stämma överens med vikterna för dessa tre sektorer i US Aggregate ex Securitized Index.

● ***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](http://www.amundietf.com).

### **Ansvarsfriskrivning**

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI MSCI PACIFIC ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB

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 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 % 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 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.

### **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<sub>2</sub>) 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 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 affärsverksamheter som kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olja och gas, inklusive borrhning 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 det överordnade indexet

3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### 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.

MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Pacific Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapperen för stora och medelstora bolag på fem utvecklade marknader i Stillahavsområdet.

Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

som viktat 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).

● ***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 förvaltat 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 att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB) samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet.

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 borrhning 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 det överordnade indexet

3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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 uteslutningspolicier (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?**

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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:

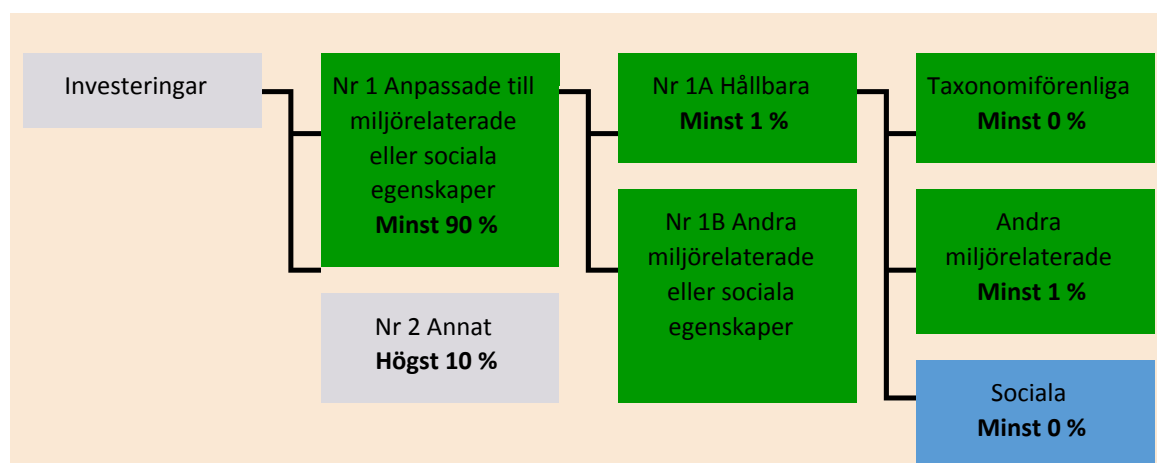
- **omsättning**, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

## Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar. Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

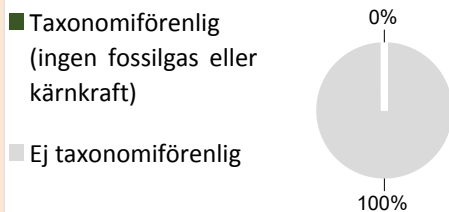
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

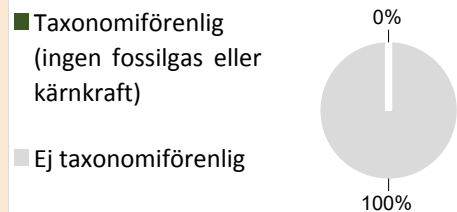
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Pacific ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Pacific Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapperen för stora och medelstora bolag på fem utvecklade marknader i Stillahavsområdet.

Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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](http://www.amundietf.com).

### Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI EMERGING EX CHINA ESG LEADERS SELECT

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800J6GAIQJ1OPP251

## 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 % 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). 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).

● ***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 Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped ("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 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 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 det överordnade 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaldade 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin må, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets ex China Index ("moderindex"), 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.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltat börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped ("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 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 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 det överordnade indexet.

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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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.

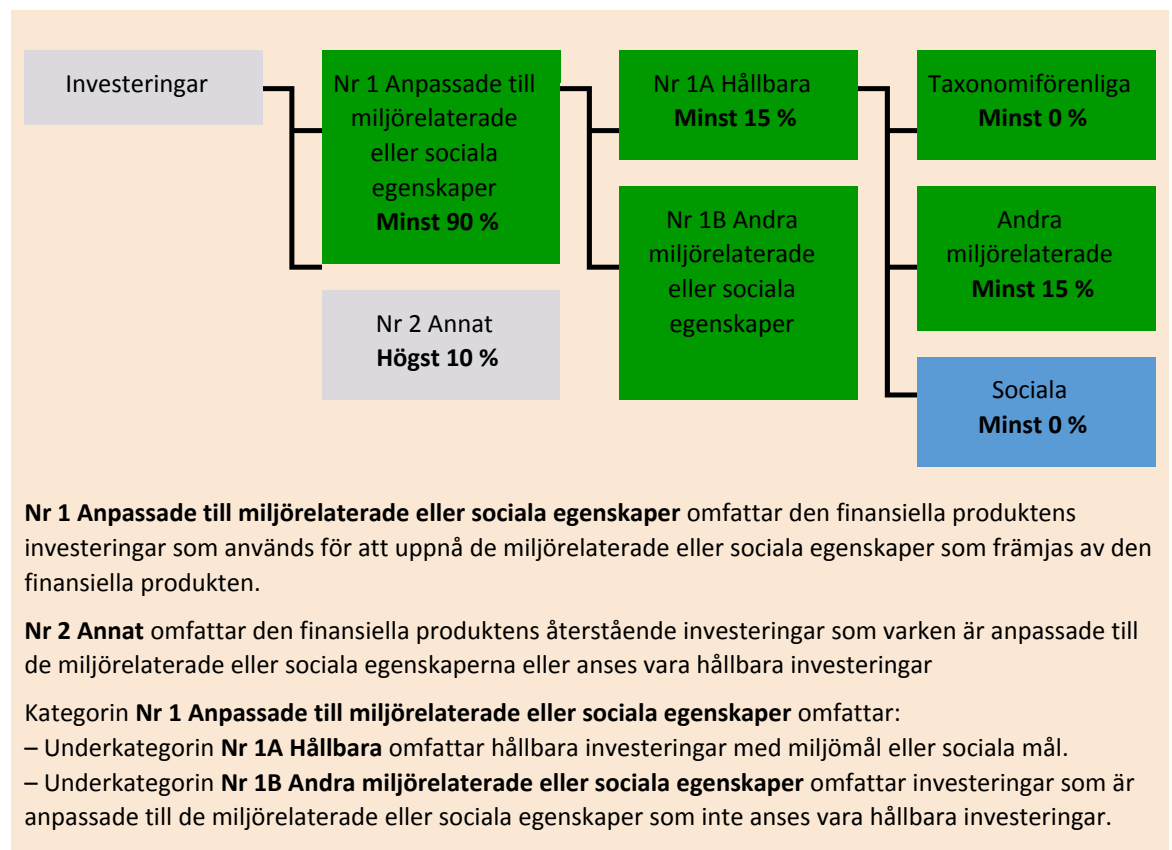
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



#### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

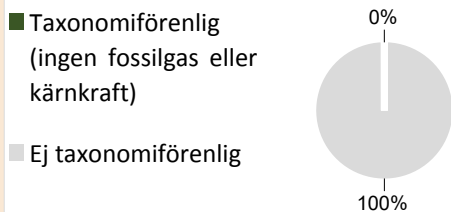
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?

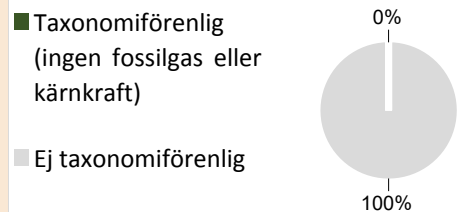
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EM ex China Region ESG Leaders Select 5% Issuer Capped är ett aktieindex baserat på MSCI Emerging Markets ex China Index ("moderindex"), 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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI MDAX ESG

Identifieringskod för juridiska personer:

213800YZZ7KZKF3GHS38

## 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 % 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).

### **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, affäretik, 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 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 (människliga 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonominns 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## 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.

● **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 förvaltnad 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 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 (männliga 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 termisk 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 uteslutningspolicier (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?***

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.



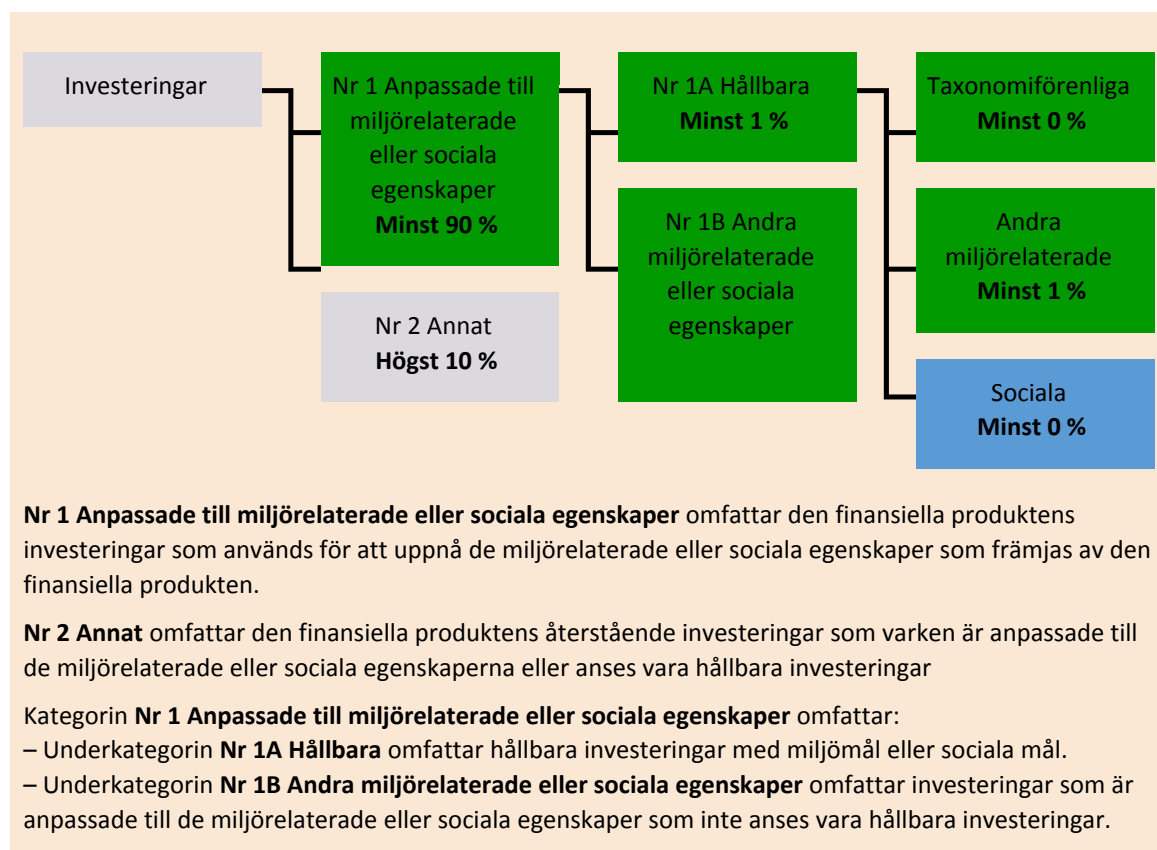
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

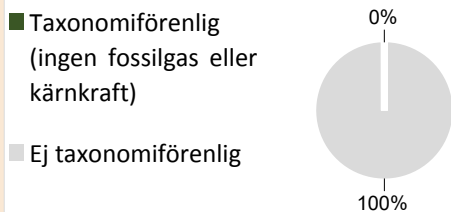
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

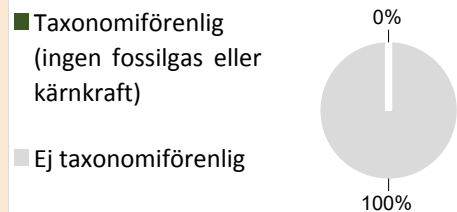
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

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](http://www.amundietf.com).

### **Ansvarsfriskrivning**

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX US CORP SRI

#### Identifieringskod för juridiska personer:

549300JEQE3CM0S0ZJ51

## 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 % 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). 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).

● ***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 US Corporate ESG Sustainability SRI 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](https://www.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](http://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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som motsvarar företagsvärdepapper som är noterade i USD med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index (överordnat index) och använder sektor- och ytterligare

risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

ESG-kriterier för värdepappersurval.

● ***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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI 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.

\* Se indexmetoden som finns på [bloombergindices.com](https://www.bloombergindices.com) för mer information om affärsområdena/verksamheterna och urvalet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?***

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



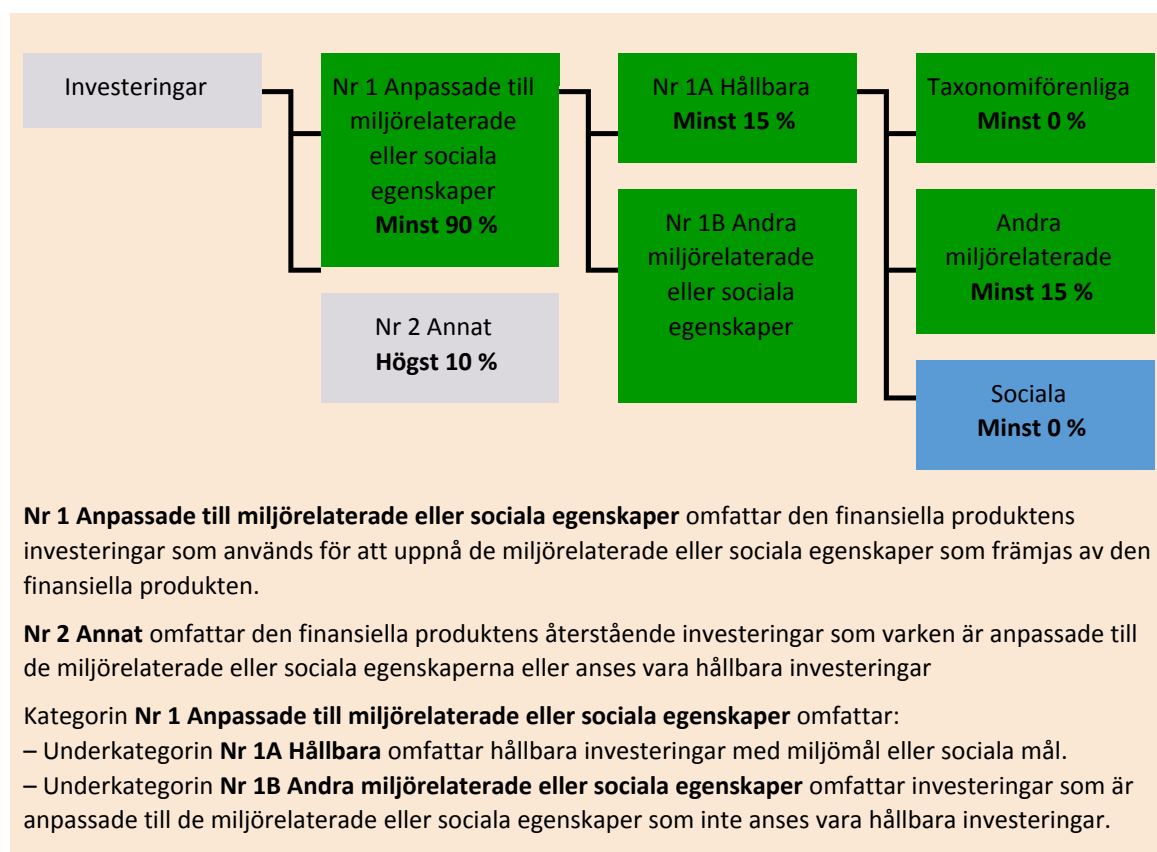
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

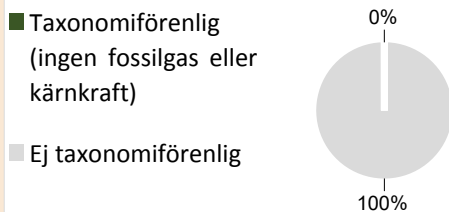
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

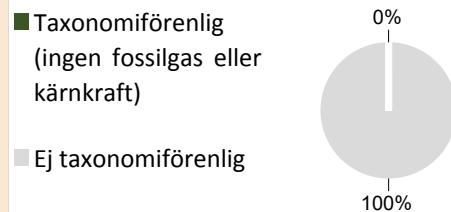
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

Bloomberg MSCI US Corporate ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som motsvarar företagsvärdepapper som är noterade i USD med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index ("överordnat index") och använder sektorkriterier och ytterligare miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier 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](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT

#### Identifieringskod för juridiska personer:

2138002DTNQGWIYKRV03

## 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 % 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 en metod med olika vikter:

- vikten för företagen med bäst ESG-betyg kommer generellt sett att vara högre.
- vikten för företagen med sämst ESG-betyg kommer generellt sett att vara lägre.

### ● 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 definieras MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT Index ("indexet") genom att utesluta värdepapper från moderindexets investeringsområde utifrån följande kriterier:

1. Företag som saknar kreditbetyg; företag som inte har utvärderats eller betygsatts av MSCI grundat på deras ESG-meriter
2. Företag som enligt denna metod har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor under de senaste tre åren
3. Företag som är inblandade i verksamhet gällande kontroversiella vapen, så som definierat enligt metoden för MSCI Ex-Controversial Weapons Indexes
4. Företag som sysslar med produktion av kol avsett att användas i värmekraftverk eller tobaksproduktion. Varje företag i det godtagbara investeringsområdet tilldelas ett kombinerat ESG-betyg, som beräknas med:

(i) aktuella ESG-betyg för värdepapper som ingår i MSCI och

(ii) det ESG-betyg som definieras som förändringen av värdepapperens ESG-betyg över tid.

Detta kombinerade ESG-betyg tillämpas sedan för att omvika de godtagbara värdepapperen 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](http://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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade

● ***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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. investeringsobjektets 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-taxonomin måls, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat

MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindex"), representativt för de stora och mellanstora marknaderna i 23 industriländer.

Indexet syftar till att representera resultatet av en strategi som ökar exponeringen jämfört med moderindexet för företag med både en robust ESG-profil samt en positiv tendens att förbättra den ESG-profilen.

Metoden syftar till att justera beståndsdelarna för viktningen av "fritt omsättbara aktier" baserat på vissa mått av miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG").

● **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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT Index ("indexet") definieras genom att utesluta värdepapper från moderindexets investeringsområde utifrån följande kriterier:

1. Företag som saknar kreditbetyg; företag som inte har utvärderats eller betygats av MSCI grundat på deras ESG-meriter

2. Företag som enligt denna metod har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor under de senaste tre åren

3. Företag som är inblandade i verksamhet gällande kontroversiella vapen, så som definierat enligt metoden för MSCI Ex-Controversial Weapons Indexes

4. Företag som sysslar med produktion av kol avsett att användas i värmekraftverk eller tobaksproduktion. Varje företag i det godtagbara investeringsområdet tilldelas ett kombinerat ESG-betyg, som beräknas med:

(i) aktuella ESG-betyg för värdepapper som ingår i MSCI och

(ii) det ESG-betyg som definieras som förändringen av värdepapperens ESG-betyg över tid.

Detta kombinerade ESG-betyg tillämpas sedan för att omvika de godtagbara värdepapperen i indexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

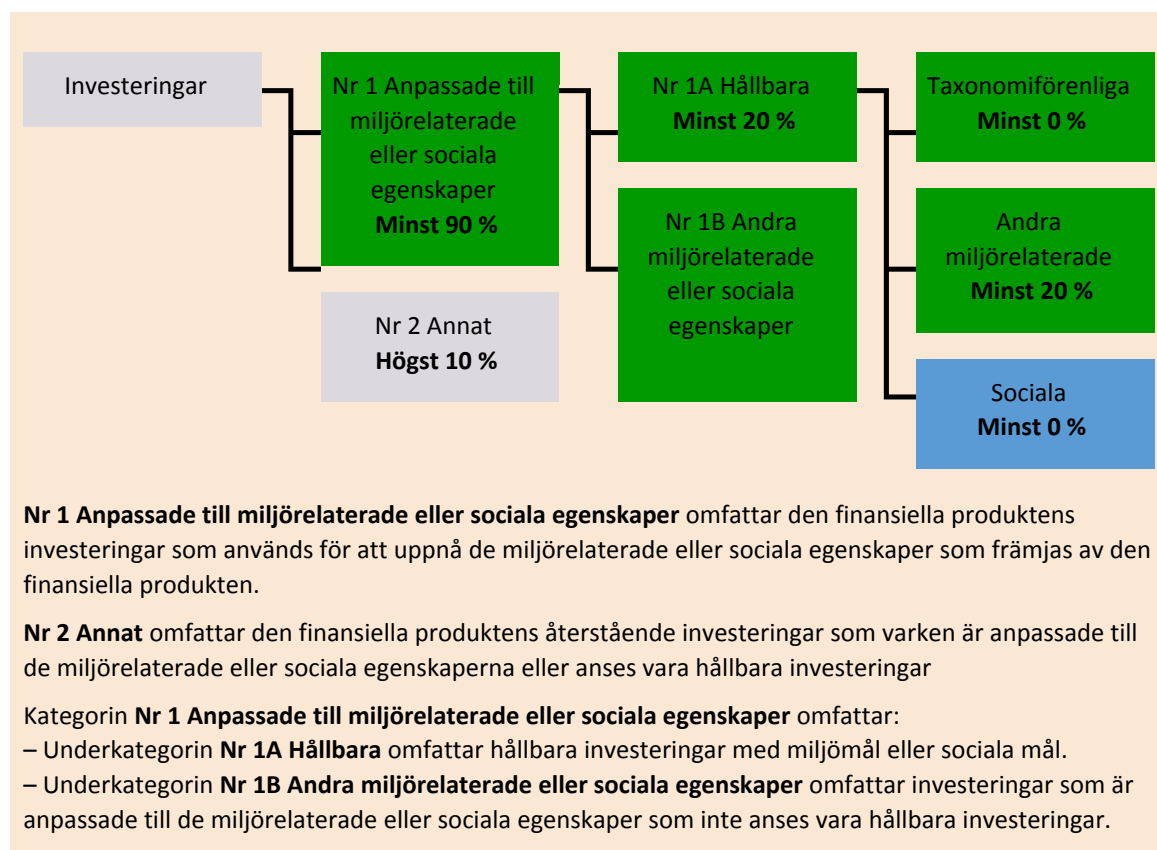
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

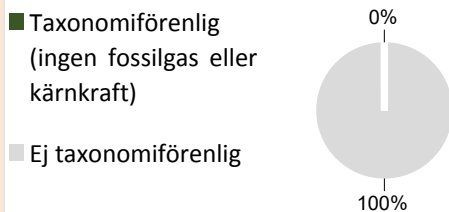
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

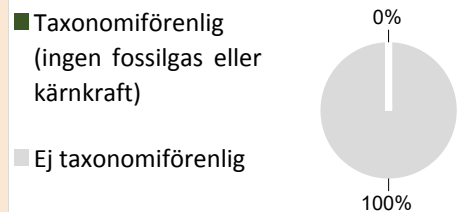
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI WORLD ESG UNIVERSAL SELECT är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindex"), representativt för de stora och mellanstora marknaderna i 23 industriländer.

Indexet syftar till att representera resultatet av en strategi som ökar exponeringen jämfört med moderindexet för företag med både en robust ESG-profil samt en positiv tendens att förbättra den ESG-profilen.

Metoden syftar till att justera beståndsdelarna för viktningen av "fritt omsättbara aktier" baserat på vissa mått av miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG").

● ***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](http://www.amundietf.com).

### Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

5493000LLOOP2JUYI637

## 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 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 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.

### **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<sub>2</sub>) 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 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 borrhning 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i moderindexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

### **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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade,

- ***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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

Bli rentvård 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används,

se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) 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 uteslutningspolicier (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](http://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.

MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapperen för stora och medelstora bolag på utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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).

● ***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 förvaltd 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 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.

#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

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 borrhning 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i moderindexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

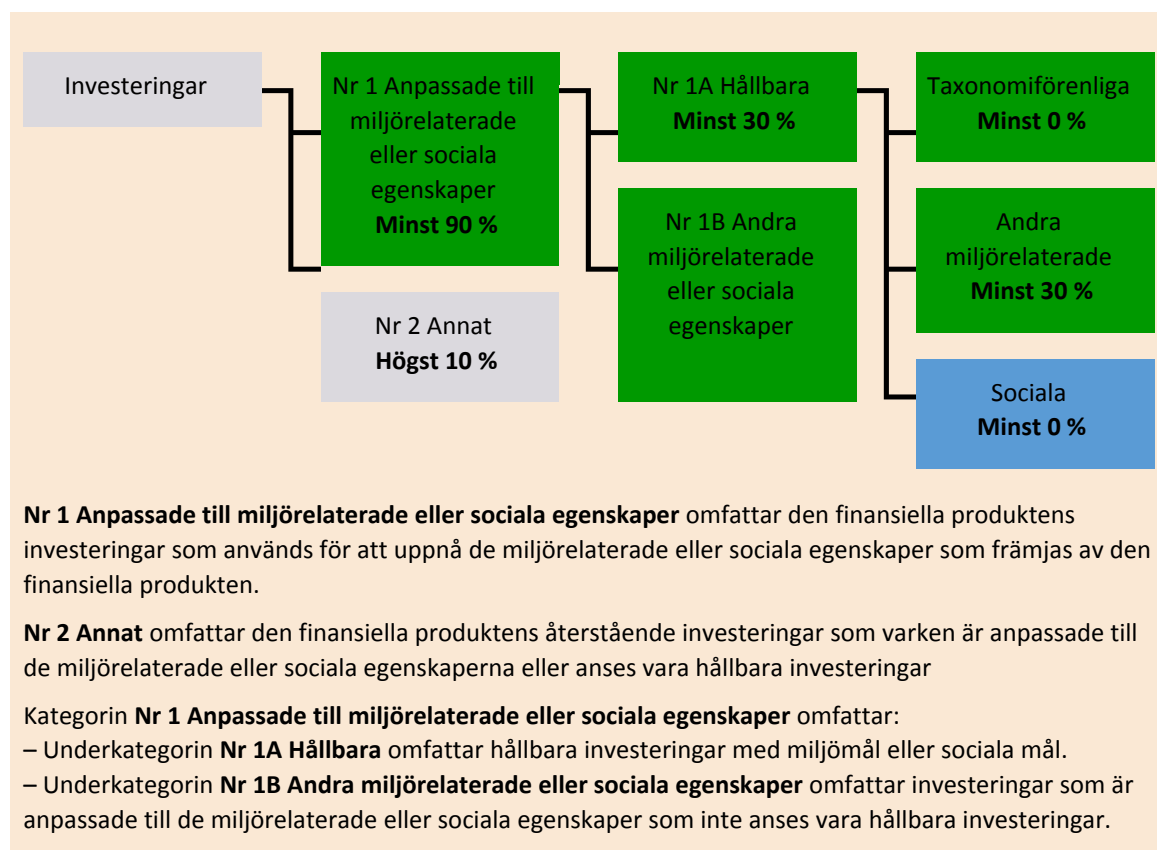
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 30 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

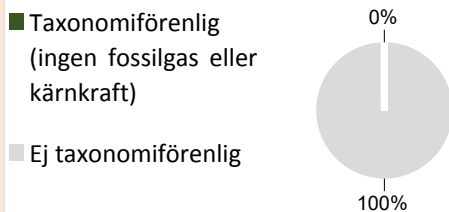
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

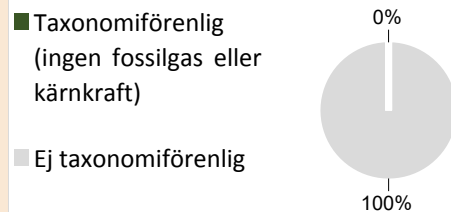
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapperen för stora och medelstora bolag på utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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](http://www.amundietf.com).

Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI USD CORPORATE BOND 0-3Y SRI

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800Q4HD4EOSIYBQ79

## 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 % 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).

### ☒ 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 US-dollar 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 US-dollar. Obligationer tas med i indexet på grundval av noteringsvalutan, inte emittentens riskland. Sedan tillämpas följande filter:

1. De värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre.
2. Företag som enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval\* ägnar sig åt affärsområden/verksamheter\* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, kärnvapen, civila skjutvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, okonventionell olja och gas, generering av termiskt kol och reserver av fossila bränslen utesluts.
3. Emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg (vilket motsvarar noll), 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-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.

### **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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som är representativt för företagsobligationer med höga kreditbetyg denominerade i US-dollar som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index ("moderindexet") med en återstående löptid på mellan en månad och tre år och tillämpar ytterligare löptids- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

### 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 förvaltat 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 US-dollar 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 US-dollar. En obligation tas med i indexet baserat på valutadenomineringen och inte emittentens riskland. Sedan tillämpas följande filter:

1. De värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre.
2. Företag som enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval\* ägnar sig åt affärsområden/verksamheter\* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, kärnvapen, civila skjutvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, okonventionell olja och gas, generering av termiskt kol och reserver av fossila bränslen utesluts.
3. Emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg (vilket motsvarar noll), 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-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.

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?***

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.



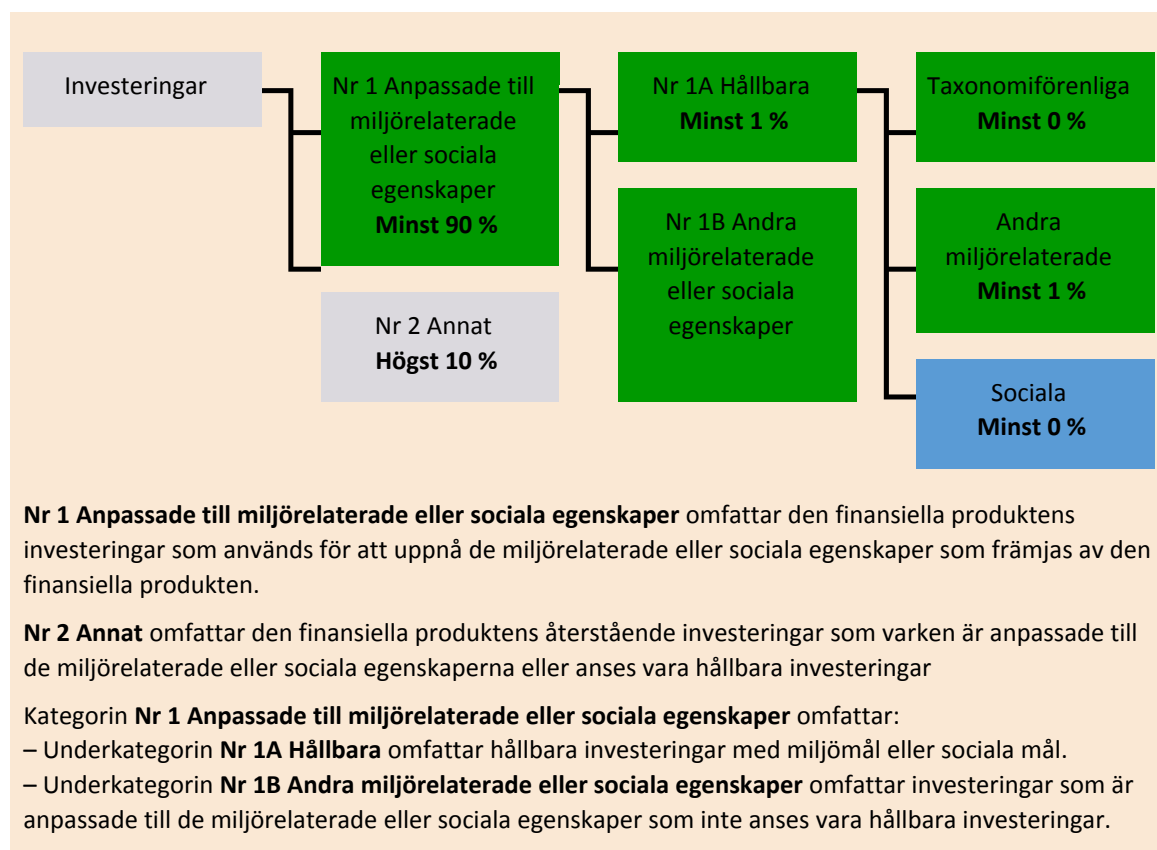
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

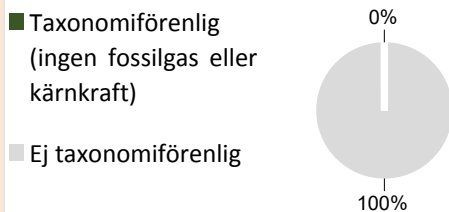
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

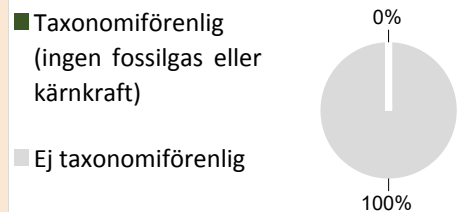
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

Bloomberg MSCI US Corporate 0-3 Year ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som är representativt för företagsobligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index ("moderindexet") med en återstående löptid på mellan en månad och tre år i slutet av varje månad och tillämpar ytterligare löptids- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

### **Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet?**

Ytterligare information om indexets underliggande komponenter finns på [bloomberg.com](https://www.bloomberg.com)



### **Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**

Mer information om delfonden finns på [www.amundi-etf.com](https://www.amundi-etf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI CHINA ESG LEADERS SELECT

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800YL23YUT5FBRB63

## 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 % 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). 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).

● ***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 Leaders Select 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 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 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 det överordnade 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin må, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI China ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

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 denominerade i US-dollar emitterade av företag med högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltnad börsnoterad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI China ESG Leaders Select 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 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 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 det överordnade indexet.

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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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.

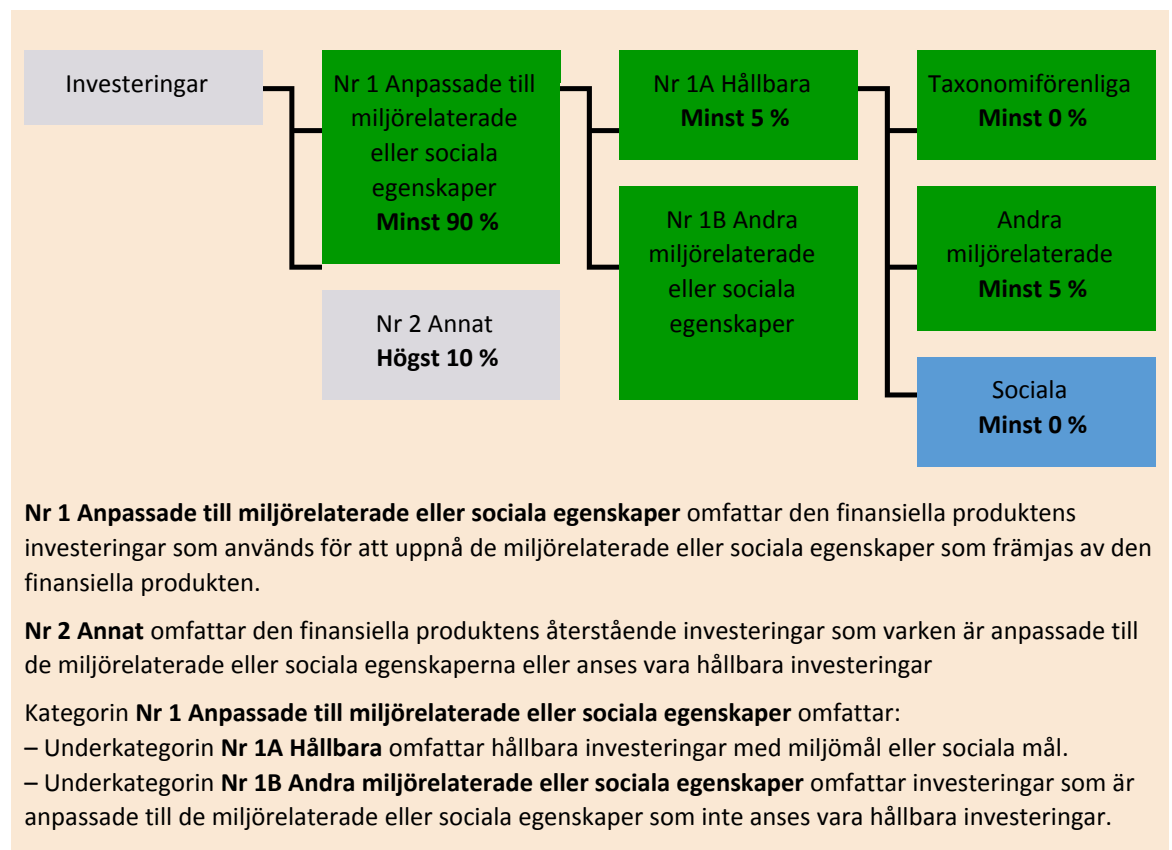
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 5 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



#### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

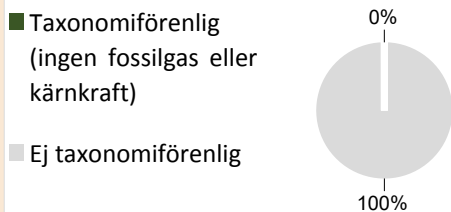
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

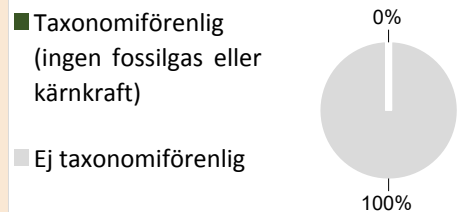
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att förbinda 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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 denominerade i US-dollar 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](http://www.amundiETF.com).

15/05/2024.



**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI CAC 40 ESG

**Identifieringskod för juridiska personer:**

549300TCOPVE58KW9N64

## 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 % 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). 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).

● ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Moody's ESG-betyg används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Moody's ESG-lösningar bedömer och betygsätter företagets resultat enligt Equitics®-metoden utifrån 38 kriterier, uppdelat på sex nyckelområden för företagets ansvar för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning. Varje emittent tilldelas ett totalt betyg av 100 (ju högre desto bättre) som är ett viktat och konsoliderat betyg för alla hållbarhetsfaktorer i en viss sektor.

Närmare bestämt är CAC 40 ESG Index ("indexet") konstruerat utifrån CAC Large 60 Index och tillämpar följande filter:

- Företag med aktiva kritiska kontroverser relaterade till FN:s Global Compact som fastställts av Moody's får inte tas med i indexet.
- Företag som enligt information från Moody's är inblandade i kontroversiella vapen, civila skjutvapen, brytning av termiskt kol, koleddad kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte tas med i indexet.

De godtagbara företagen rangordnas i fallande ordning efter ESG-betyget enligt Moody's. Vid händelse av samma poängantal kommer företaget med högst fritt omsättningsbart börsvärde att rankas högre.

● ***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](http://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 förvaldade 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. 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 "presterar bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presterar bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presterar 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonominns 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### 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 som motsvarar de 40 största bolagen i CAC Large 60 Index (överordnat index) som motsvarar de 60 ledande aktierna på Parisbörsen som har visat kraftfull miljöpraxis, social praxis och bolagsstyrningspraxis. Indexets syfte är att leverera ett mindre viktat koldioxidavtryck och ett bättre grönt/brunt-förhållande jämfört med det överordnade indexet.

#### ● 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

CAC 40 ESG Index ("indexet") är konstruerat utifrån CAC Large 60 Index och tillämpar följande filter:

– Företag med aktiva kritiska kontroverser relaterade till FN:s Global Compact som fastställts av Moody's får inte tas med i indexet.

– Företag som enligt information från Moody's är inblandade i kontroversiella vapen, civila skjutvapen, brytning av termiskt kol, koleddad kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte tas med i indexet.

De godtagbara företagen rangordnas i fallande ordning efter ESG-betyget enligt Moody's. Vid händelse av samma poängantal kommer företaget med högst fritt omsättningsbart börsvärde att rankas högre.

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?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

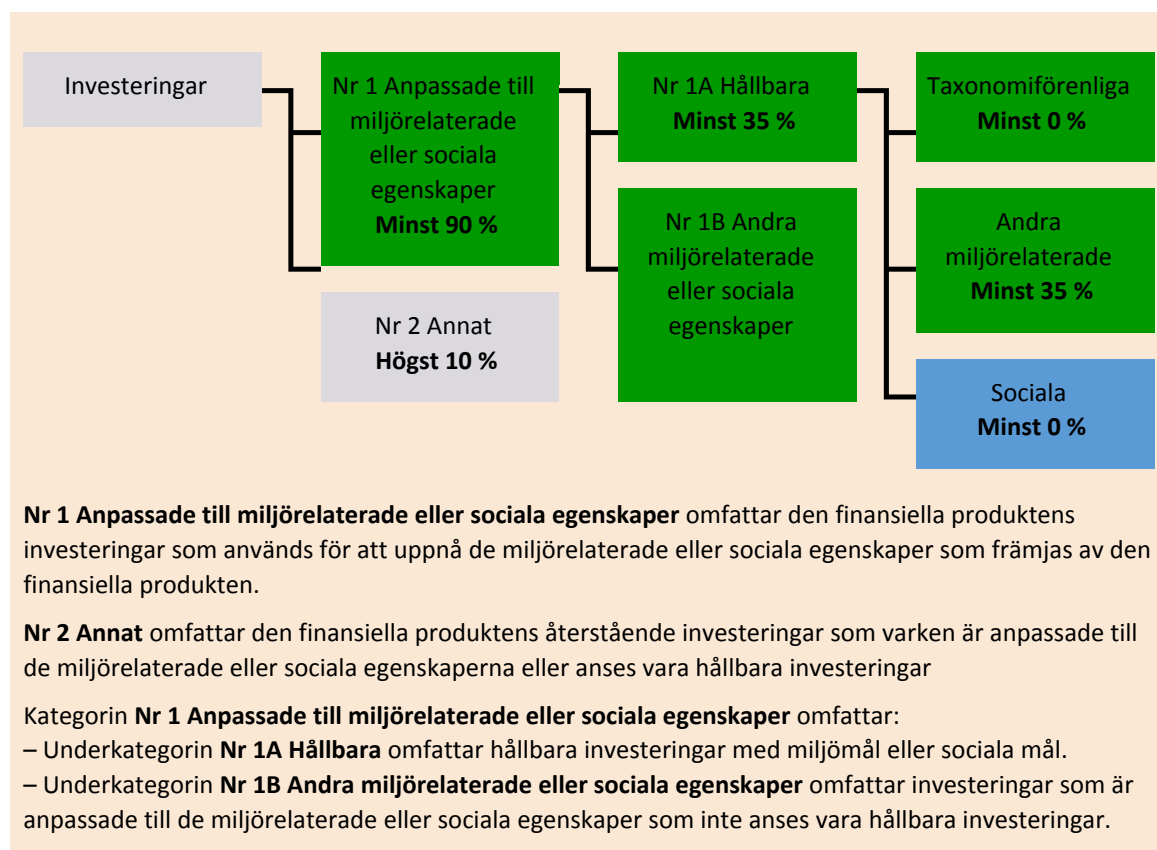
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 35 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

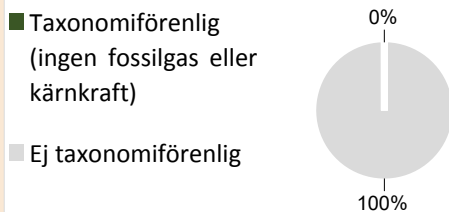
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

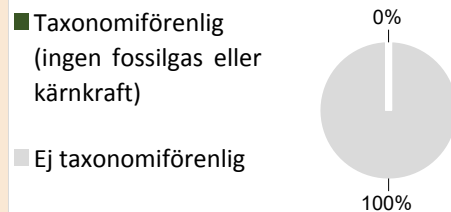
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

CAC 40 ESG Index är ett aktieindex som motsvarar de 40 största bolagen i CAC Large 60 Index, som motsvarar de 60 ledande aktierna på Parisbörsen ("överordnat index"), som har visat kraftfull miljöpraxis, social praxis och bolagsstyrningspraxis. Indexets syfte är att ge ett minskat viktat koldioxidavtryck och bättre grönt/brunt-förhållande jämfört med det överordnade indexet.

● ***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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI EMU ESG LEADERS SELECT

#### Identifieringskod för juridiska personer:

2221007ZZU8XN39KWS32

## 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 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 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). 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).

● ***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 Leaders Select 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, 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 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 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 det överordnade 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](http://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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin må, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

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.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EMU ESG Leaders Select 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, 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 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 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 det överordnade indexet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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.

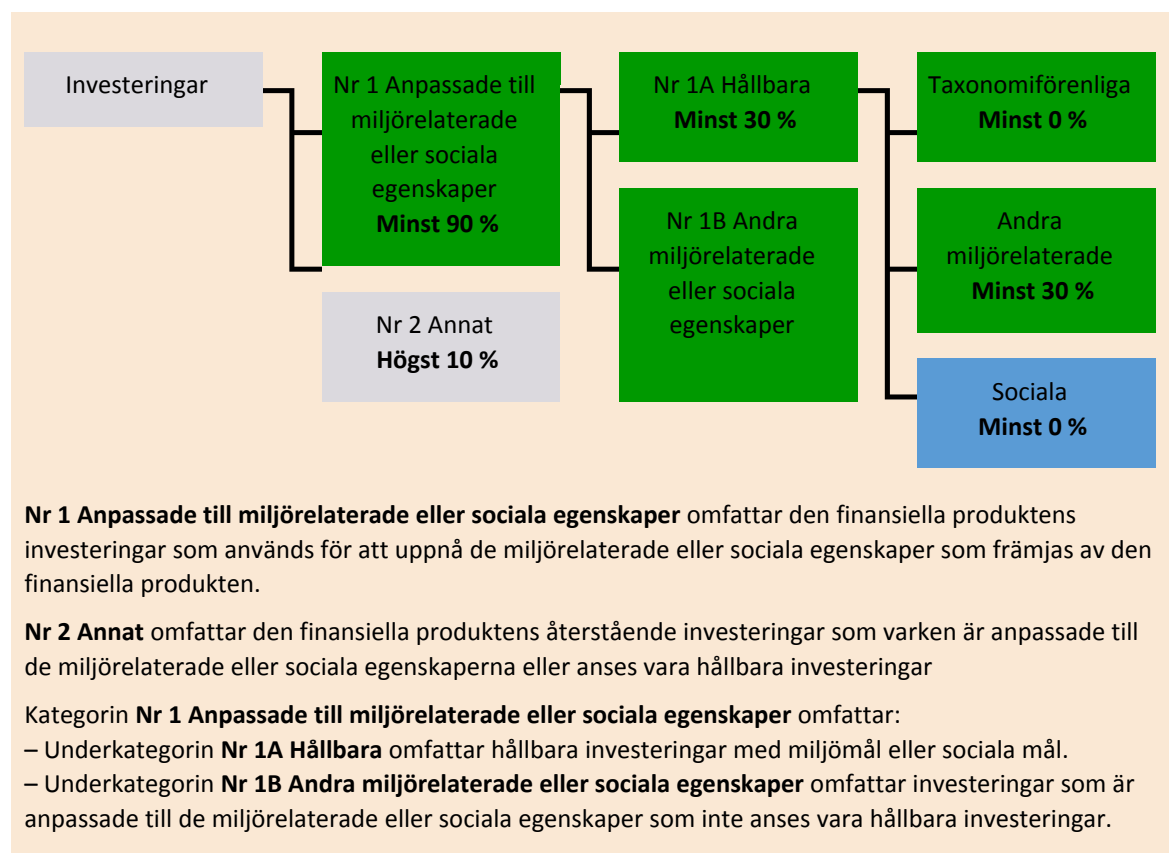
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 30 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



#### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

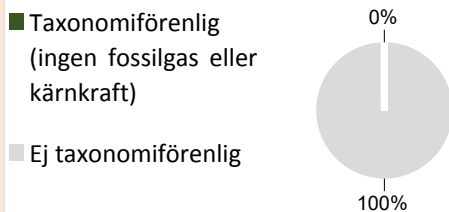
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

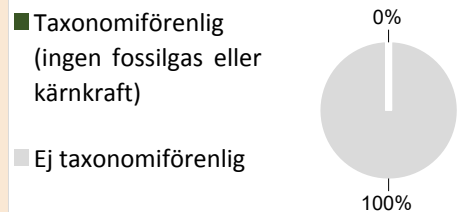
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI GLOBAL AGG SRI

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 % 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). 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).

● ***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 Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral 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](https://www.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](http://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 förvaldade 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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized Sustainable SRI Sector Neutral Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

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

risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

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.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI Global Aggregate 500MM ex Securitized 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, 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](https://www.bloomberg.com/indices) 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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

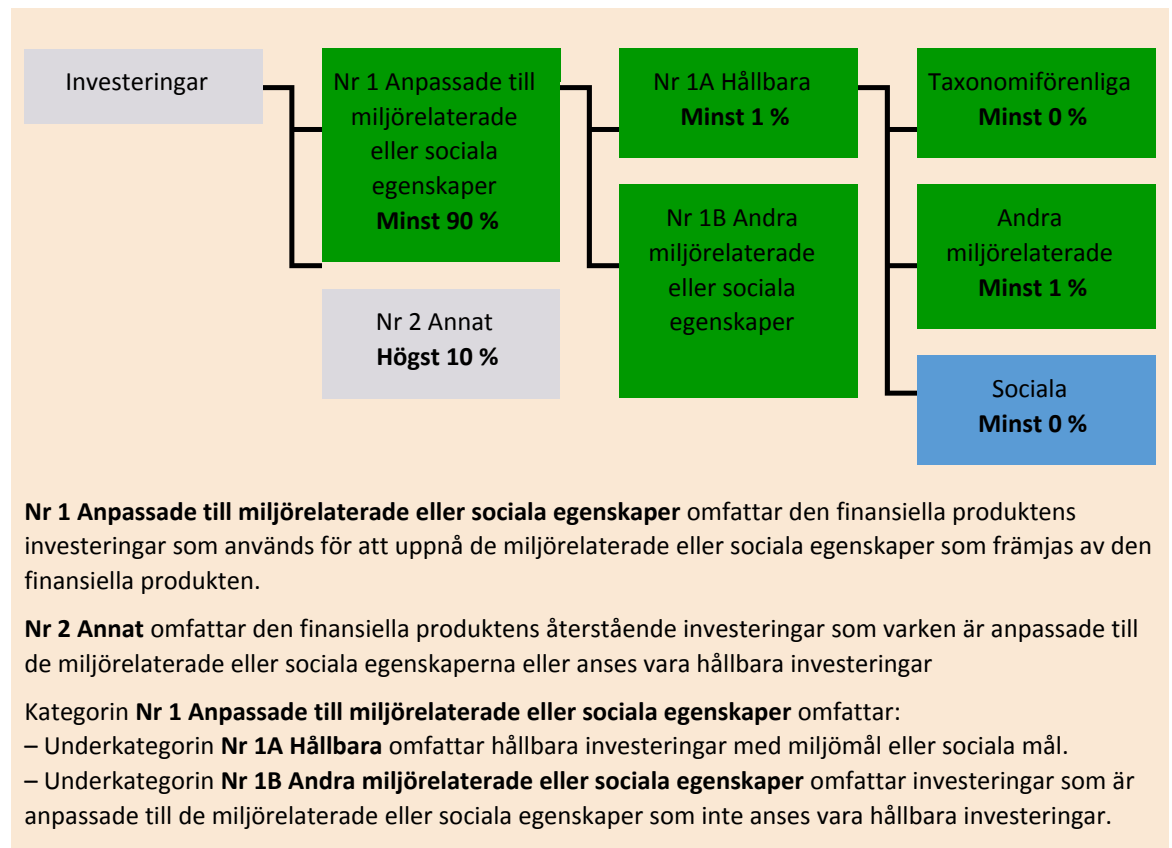
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

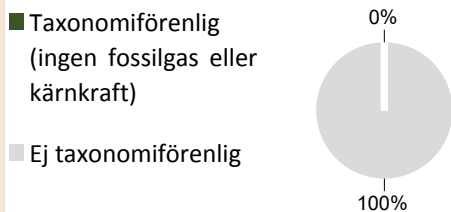
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

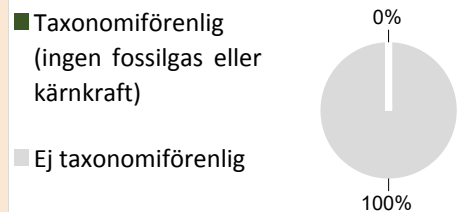
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 36 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

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 ("överordnat index") 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](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI PAB

#### 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 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 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 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

### **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<sub>2</sub>) 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 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 det överordnade indexet.

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-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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 högentensiva 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

## 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 ("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 viktat om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

### ● **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 förvaltnad 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.

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 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 det överordnade indexet.

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-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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

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?**

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

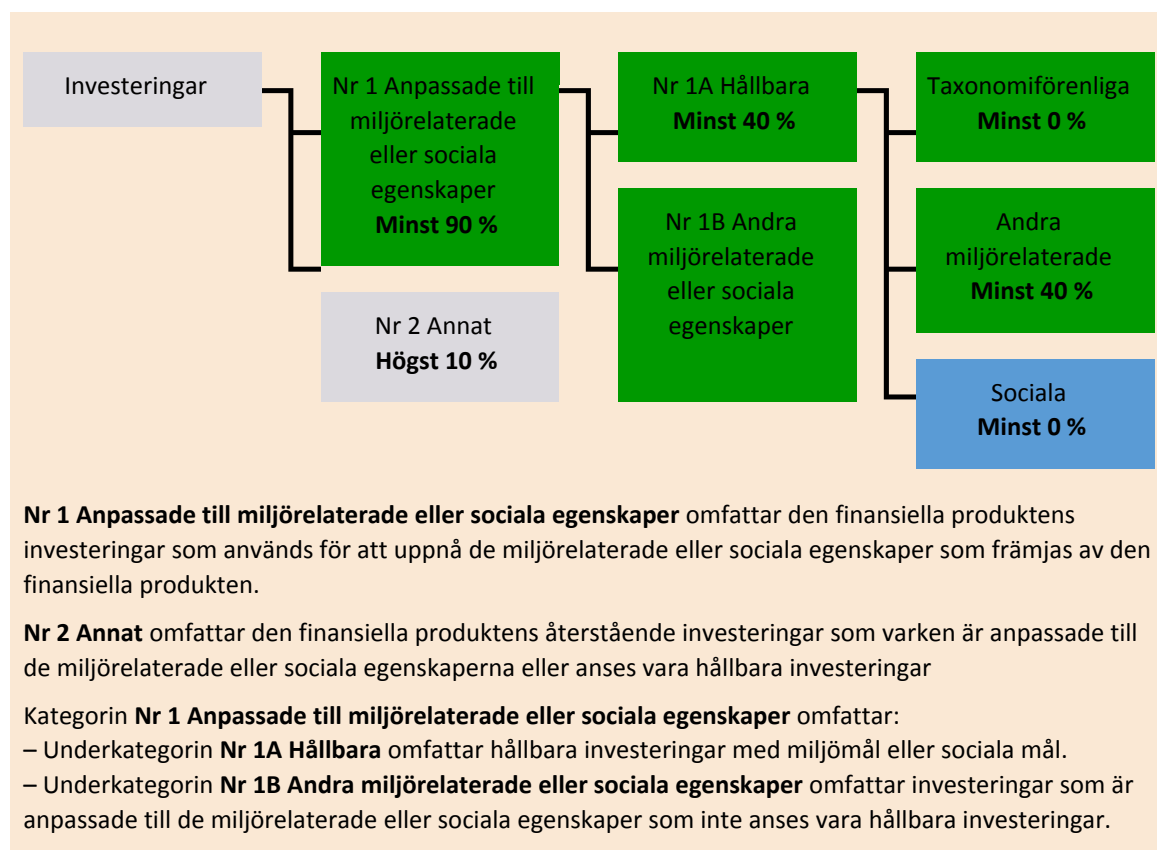
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 40 % 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 40 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

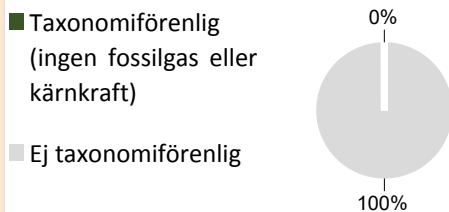
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

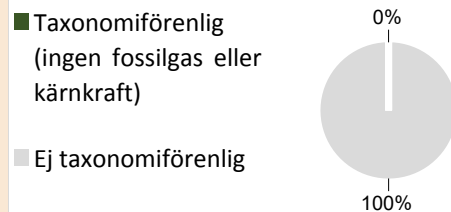
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 40 % 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Europe SRI Filterd PAB Index 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 viktat 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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).



Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

2138002M8UPUVNSJT429

## 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 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 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

### **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<sub>2</sub>) 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 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 det överordnade indexet. 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 högentensiva 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU SRI Filterd PAB Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EMU SRI Filterd 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 viktat om värdepapper baserat på de möjligheter och



**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

● ***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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EMU SRI Filterd 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 Filterd 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 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 det överordnade indexet. 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

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?**

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

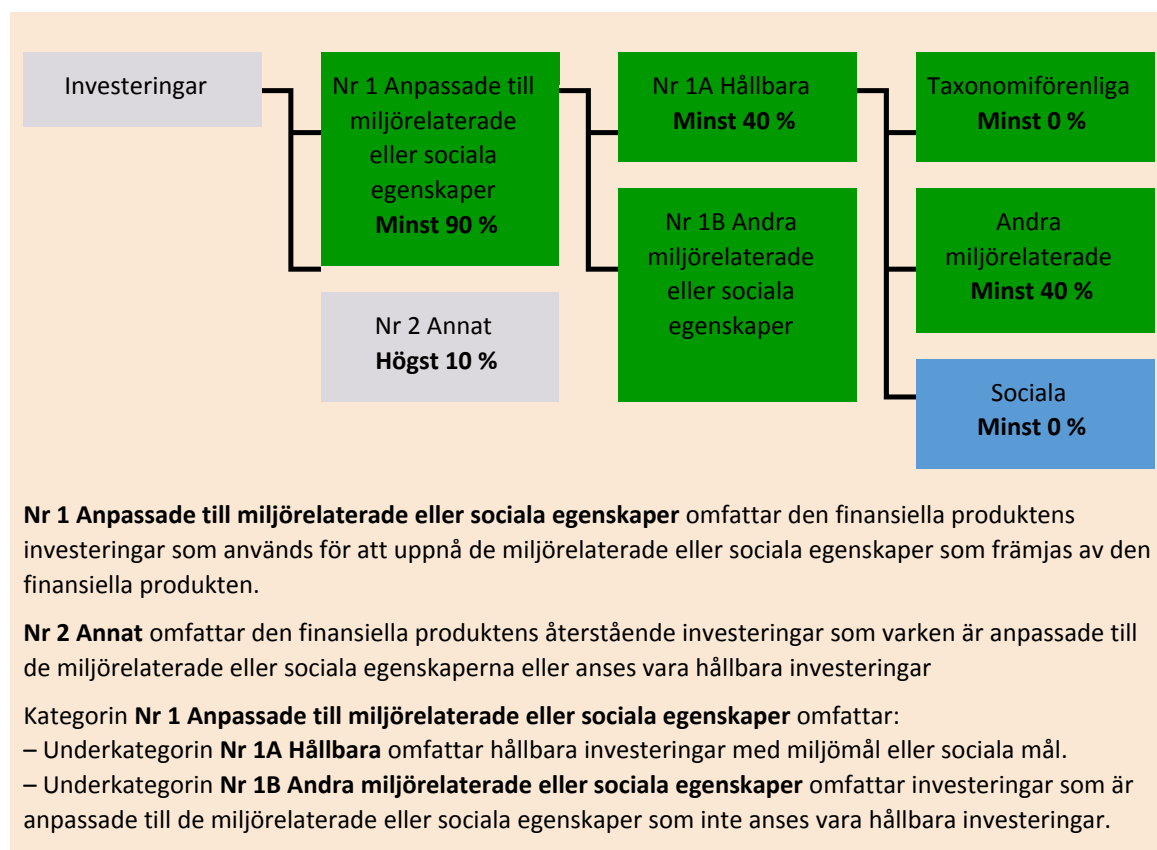
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas i enlighet med de bindande elementen i indexmetoden. Dessutom förbinder sig delfonden att ha minst 40 % 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 40 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

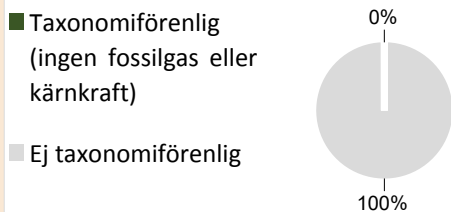
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

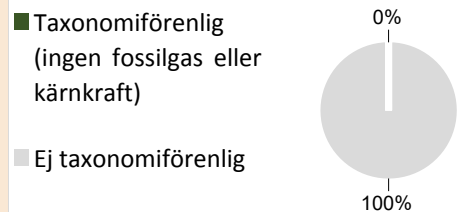
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 40 % 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EMU SRI Filterd 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 viktat 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI MSCI EMU CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB

**Identifieringskod för juridiska personer:**

2138007S1QFFN8UYKB61

## 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

☐ 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 % 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.

**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<sub>2</sub>) dividerat med företagsvärdet inklusive konanter.

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 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, elproduktion och vapen baserade 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:

- Minsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med moderindexet.
- Minsta genomsnittliga minskning (per år) av växthusgasintensiteten med 10 % i förhållande till växthusgasintensiteten vid basdatumet.
- Aktiv vikt i sektorn med hög klimatpåverkan som är minst lika stor som moderindexets.
- Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i moderindexet.
- Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till moderindexet.
- Ökning av sammanlagt klimat-VaR under 1,5-gradersscenariot och jämfört med moderindexet; MSCI:s mått på klimat-VaR hjälper investerare att bedöma framtida kostnader relaterade till klimatförändringar och förstå vad dessa framtida kostnader kan innebära i den aktuella värderingen av värdepapper.
- Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande till moderindexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:

- Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till moderindexet.
- Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter/viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen i förhållande till moderindexet.
- Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till moderindexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdelars aktiva vikt, beståndsdelars 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](https://www.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 "presterar bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presterar bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presterar 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](http://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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered Index (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered 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. Indexet innehåller rekommendationerna från arbetsgruppen om klimatrelaterade finansiella informationskrav (TCFD) och är utformade för att överträffa minimistandarderna i EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet.

### **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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered 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, elproduktion och vapen baserade 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:

- Minsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med moderindexet.
- Minsta genomsnittliga minskning (per år) av växthusgasintensiteten med 10 % i förhållande till växthusgasintensiteten vid basdatumet.
- Aktiv vikt i sektorn med hög klimatpåverkan som är minst lika stor som moderindexets.
- 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. Ökning av sammanlagt klimat-VaR under 1,5-gradersscenariot och jämfört med moderindexet; MSCI:s mått på klimat-VaR hjälper investerare att bedöma framtida kostnader relaterade till klimatförändringar och förstå vad dessa framtida kostnader kan innebära i den aktuella värderingen av värdepapper.

g. 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/viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen i förhållande till moderindexet.

c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till moderindexet.

3. Dessutom införs följande begränsningar för att uppfylla diversifieringsmålen: beståndsdelens aktiva vikt, beståndsdelens 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.

## ● ***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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

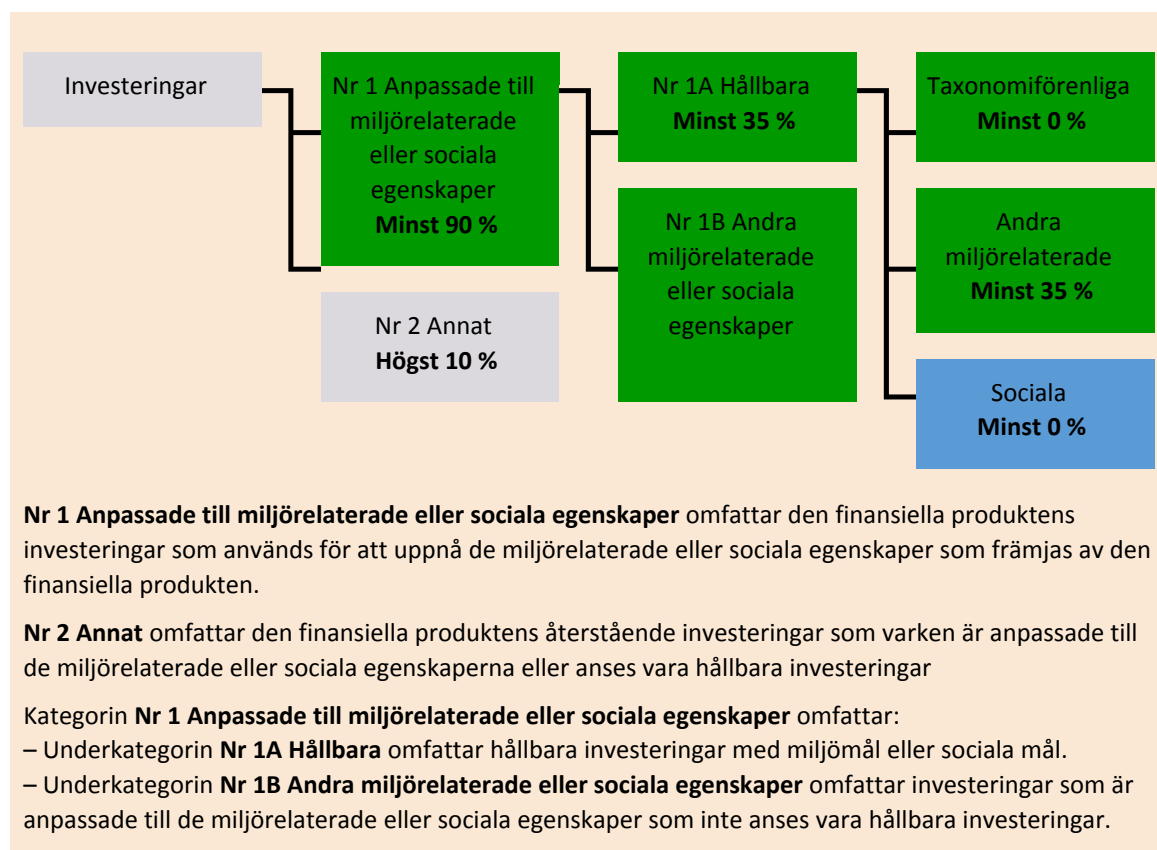
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 35 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

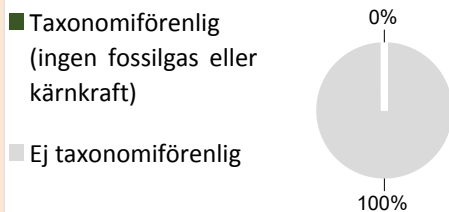
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

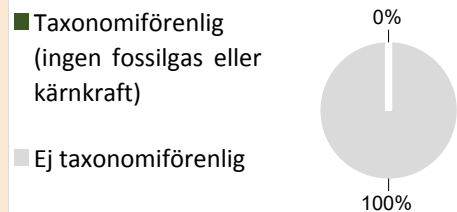
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered 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. 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI JAPAN SRI PAB

#### 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 % 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

### **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<sub>2</sub>) 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 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 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 det överordnade indexet.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaldade 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonominns 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Japan SRI Filterd PAB Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI Japan SRI Filterd PAB Index 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 viktat om värdepapper baserat

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

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).

● ***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 förvaltd 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 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 det överordnade indexet.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?**

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

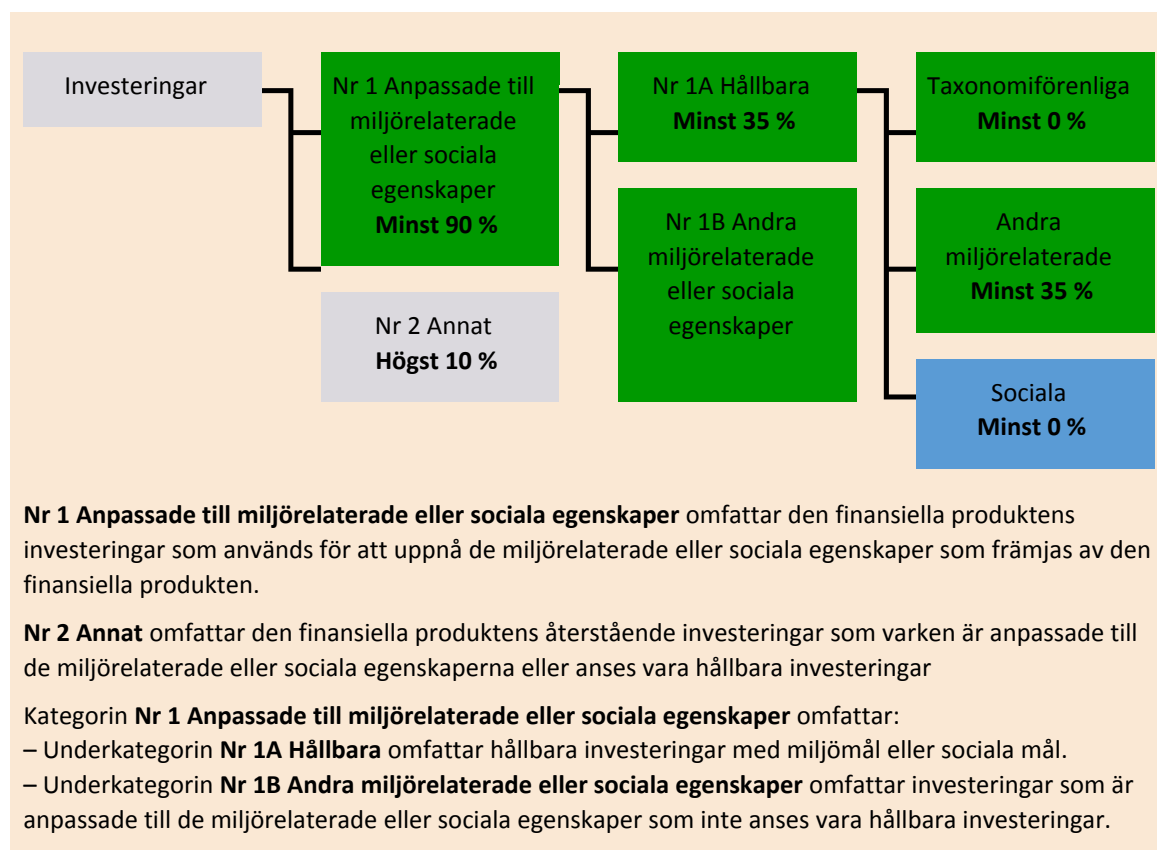
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 35 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

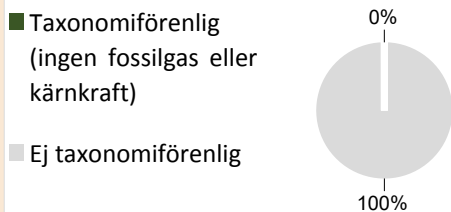
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

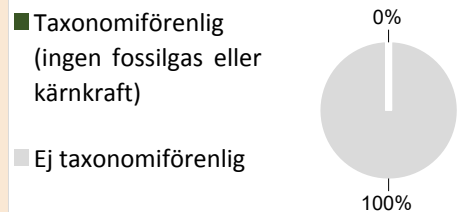
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

MSCI Japan SRI Filtered PAB Index 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 viktas 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE PARIS ALIGNED PAB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800MMM38NXMDMHQ95

## 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 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 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

### **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<sub>2</sub>) dividerat med företagsvärdet inklusive konstanter.

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 strävar MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index ("indexet") efter att minska sin växthusgasintensitet med minst 50 % jämfört med moderindexet och är avsett att uppfylla målet att minska koldioxidutsläppen med 7 % jämfört med föregående år.

Indexet konstrueras enligt följande:

- Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla befintliga beståndsdelar i moderindexet (dvs. aktier i medelstora och stora bolag som motsvarar 85 % av det totala börsvärdet för det geografiska område som moderindexet omfattar).

- Det initiala investeringsområdet konstrueras genom att utesluta värdepapper från det tillämpliga investeringsområdet baserat på följande kriterier:

1. Företag utan kreditbetyg: företag som inte har fått något kreditbetyg från MSCI ESG Research for Low Carbon Transition Assessment.

2. Företag som är verksamma inom kontroversiella vapen, enligt definitionen i metoden för MSCI Ex Controversial Weapons Indexes.

Varje återstående företag viktas enligt sitt börsvärde och sin sammanlagda poäng från Low Carbon Transition (LCT)\* för att öka exponeringen mot företag som tar del av möjligheter i samband med klimatomställningen och minska exponeringen mot företag som utsätts för risker i samband med klimatomställningen.

- Det godtagbara investeringsområdet konstrueras utifrån det initiala investeringsområdet genom att utesluta värdepapper baserat på följande kriterier:

1. Företag som har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor,

2. Företag som är verksamma inom tobak, kol, olja och gas, elproduktion baserad på termiskt kol, elproduktion med flytande bränsle, olje- och gasbaserad elproduktion.

- Både moderindexet och det godtagbara investeringsområdet delas in i två områden\*\*: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan".

- Det slutliga investeringsområdet konstrueras utifrån det godtagbara investeringsområdet genom viktning: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan" i enlighet med deras respektive allokeringar i moderindexet och värdepapperen baserat på deras mål och åtaganden att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Varje värdepappers vikt i indexet begränsas till 4 %.

● ***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](http://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 förvaldade 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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindexet"), som är representativt för marknaderna med stora och medelstora bolag i 23 utvecklade länder (per mars 2020). Indexet syftar till att representera resultatet för en strategi som viktat om

risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU-referensvärdet för anpassning till Parisavtalet.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index ("indexet") strävar efter att minska sin växthusgasintensitet med minst 50 % jämfört med moderindexet och är avsett att uppfylla målet att minska koldioxidutsläppen med 7 % jämfört med föregående år.

Indexet konstrueras enligt följande:

- Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla befintliga beståndsdelar i moderindexet (dvs. aktier i medelstora och stora bolag som motsvarar 85 % av det totala börsvärdet för det geografiska område som moderindexet omfattar).

- Det initiala investeringsområdet konstrueras genom att utesluta värdepapper från det tillämpliga investeringsområdet baserat på följande kriterier:

1. Företag utan kreditbetyg: företag som inte har fått något kreditbetyg från MSCI ESG Research for Low Carbon Transition Assessment.

2. Företag som är verksamma inom kontroversiella vapen, enligt definitionen i metoden för MSCI Ex Controversial Weapons Indexes.

Varje återstående företag viktas enligt sitt börsvärde och sin sammanlagda poäng från Low Carbon Transition (LCT)\* för att öka exponeringen mot företag som tar del av möjligheter i samband med klimatomställningen och minska exponeringen mot företag som utsätts för risker i samband med klimatomställningen.

- Det godtagbara investeringsområdet konstrueras utifrån det initiala investeringsområdet genom att utesluta värdepapper baserat på följande kriterier:

1. Företag som har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor,

2. Företag som är verksamma inom tobak, kol, olja och gas, elproduktion baserad på termiskt kol, elproduktion med flytande bränsle, olje- och gasbaserad elproduktion.

- Både moderindexet och det godtagbara investeringsområdet delas in i två områden\*\*: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan".

- Det slutliga investeringsområdet konstrueras utifrån det godtagbara investeringsområdet genom viktning: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan" i enlighet med deras respektive allokeringar i moderindexet och värdepapperen baserat på deras mål och åtaganden att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Varje värdepappers vikt i indexet begränsas till 4 %.

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?***

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

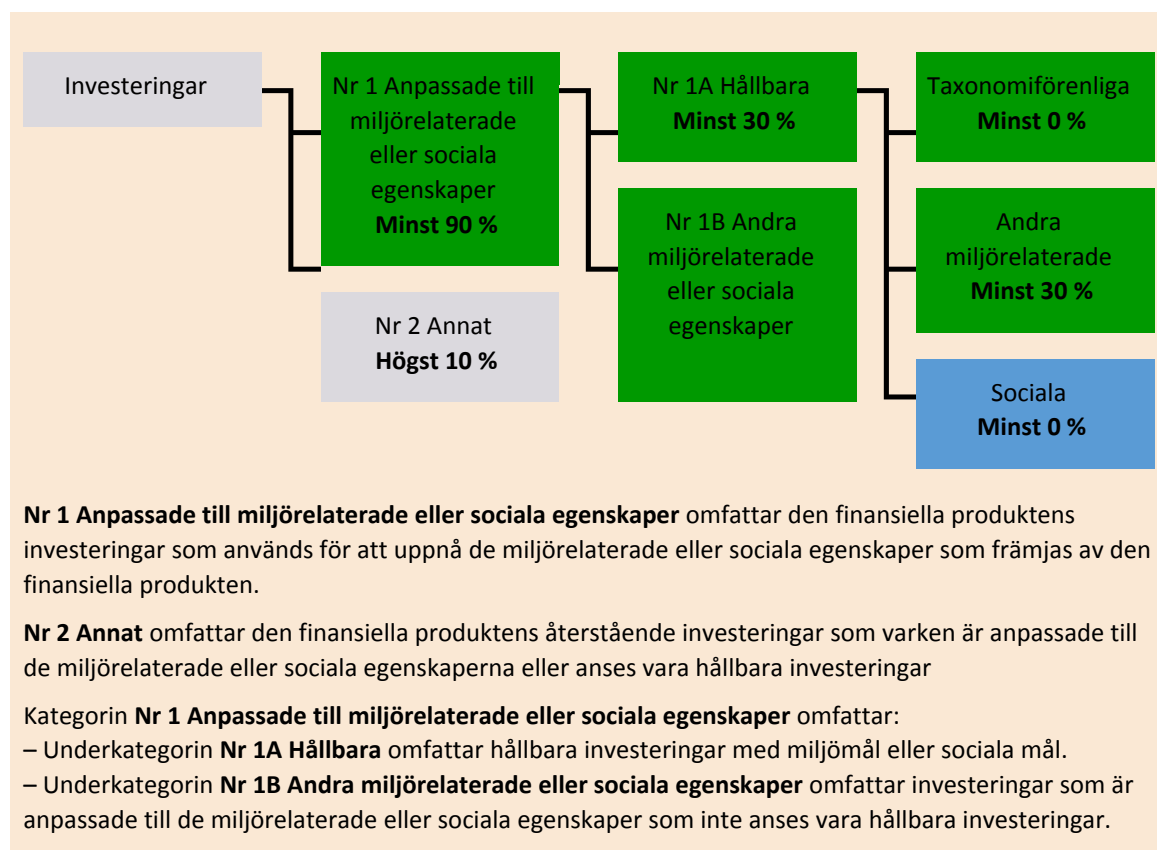
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 30 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

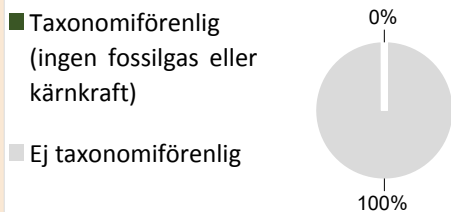
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

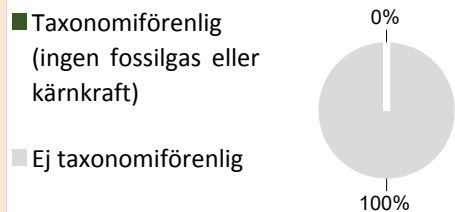
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI World Climate Change Paris Aligned Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindexet"), som är representativt för marknaderna med stora och medelstora bolag i 23 utvecklade länder (per mars 2020). Indexet syftar till att representera resultatet för en strategi som viktas om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU-referensvärdet 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](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI PAB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

22210085PY3LW5RGLP55

## 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 % 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

### **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<sub>2</sub>) 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 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 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 det överordnade indexet.

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.

### ● ***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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin måls, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### 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.

MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index 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 Stilla-havsområdet undantaget Japan (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har enastående 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

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

resultatet för en strategi som viktat 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).

● ***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 förvaltnad 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 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 det överordnade indexet.

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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

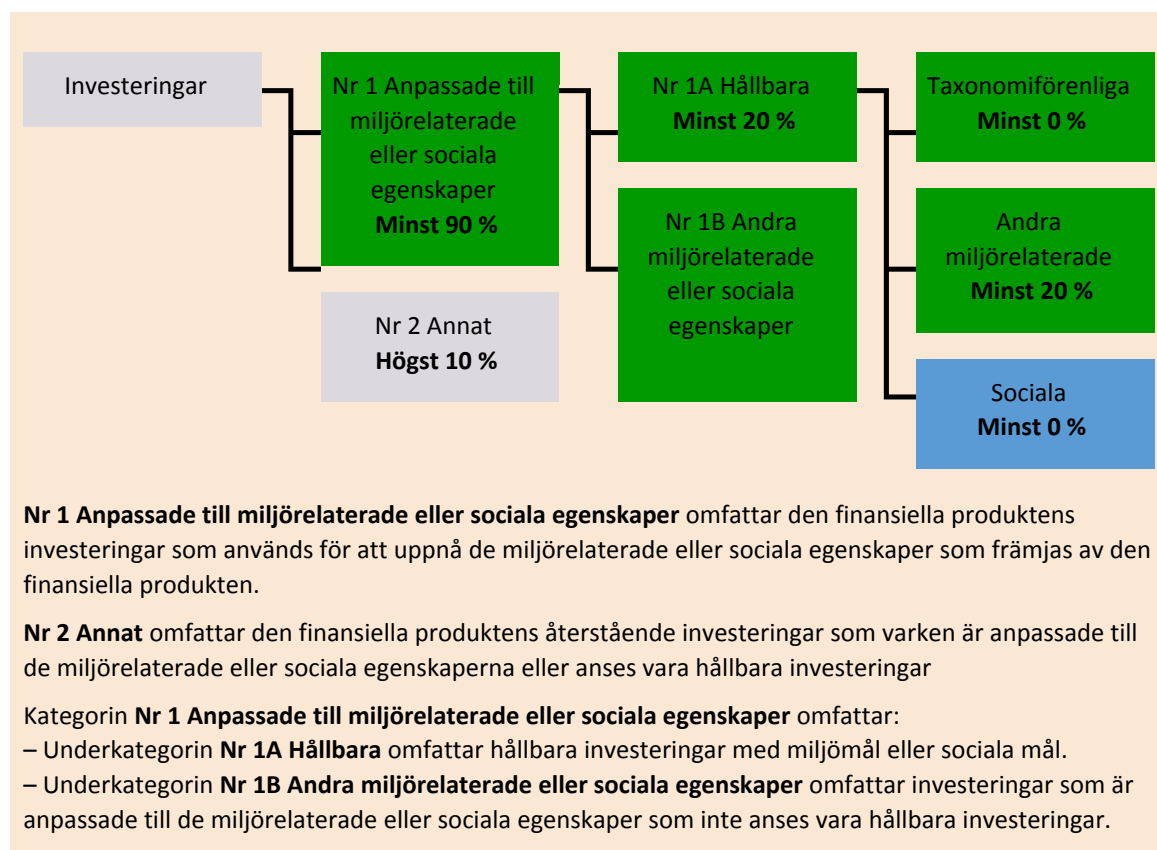
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

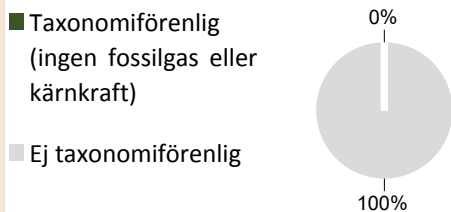
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?

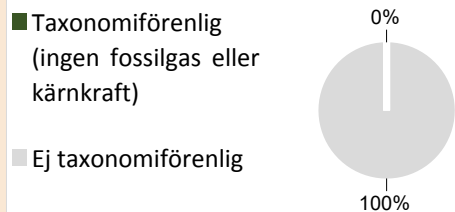
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Pacific ex Japan SRI Filtered PAB Index 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 Stilla-havsområdet undantaget Japan (per november 2021). Indexet ger exponering mot företag som har enastående 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 viktat 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI MSCI AC FAR EAST EX JAPAN ESG LEADERS SELECT

**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 10 % 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). 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).

● ***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 Leaders Select 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](http://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. 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

Bli rentvård 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-taxonoms 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

☐ Nej



### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 5% Issuer Capped index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

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.

### ● 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI Ac Far East ex Japan ESG Leaders Select 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.

### ● 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

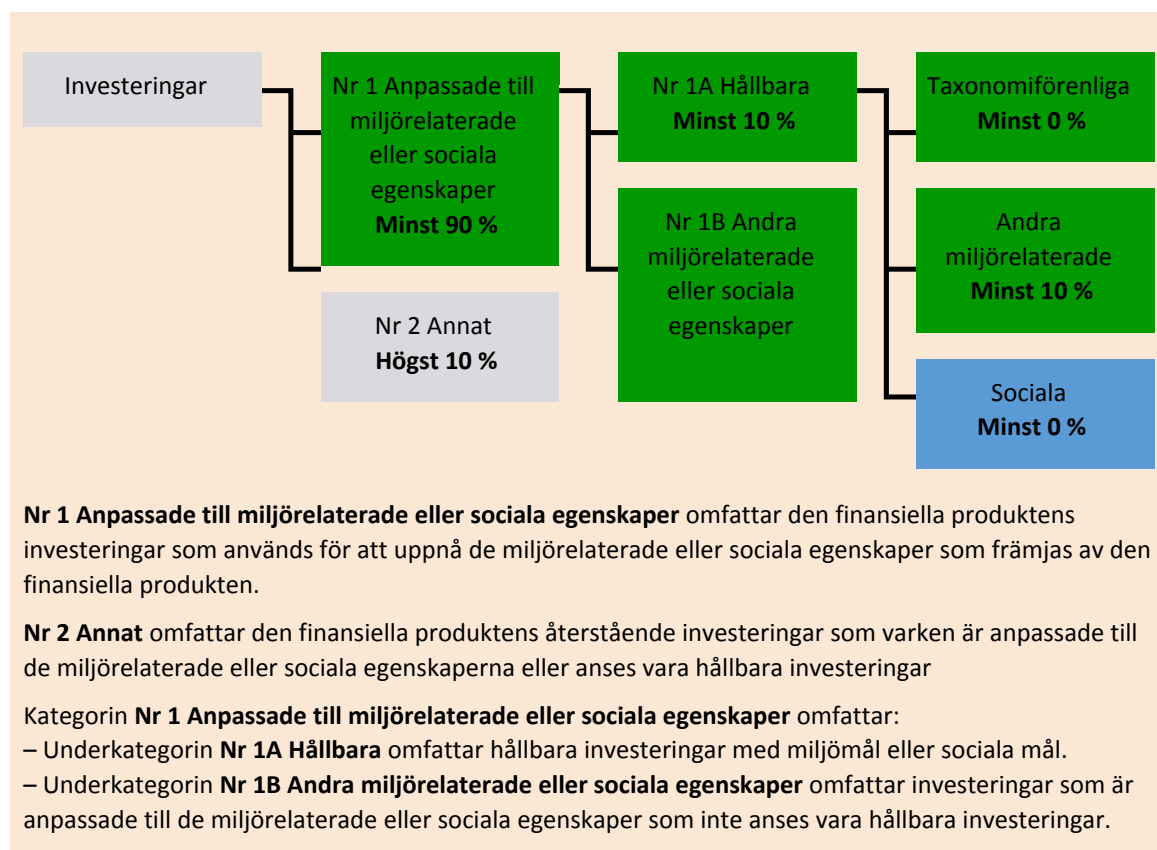
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 (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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 10 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

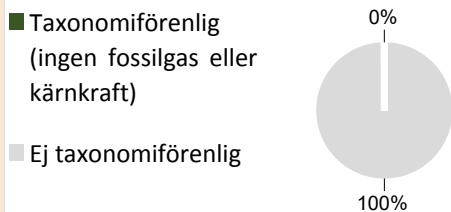
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

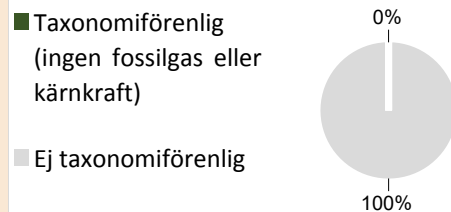
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).



15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI MSCI JAPAN ESG CLIMATE NET ZERO AMBITION CTB

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 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 % 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 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.

### **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<sub>2</sub>) 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 att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka MSCI 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 är involverade i affärsverksamhet enligt MSCI ESG Research\*, däribland kärnvapen, tobak, konventionella vapen, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol eller okonventionell olja och gas, inklusive borrhning 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 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 det överordnade indexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaldade 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonominns 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### 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.

MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI JAPAN Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapper för stora och medelstora bolag på den japanska marknaden. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med



### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB).

### ● **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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index sammansätts genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka MSCI ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning (EU CTB) samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet.

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 borrhning 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 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 det överordnade indexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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.

### ● **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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

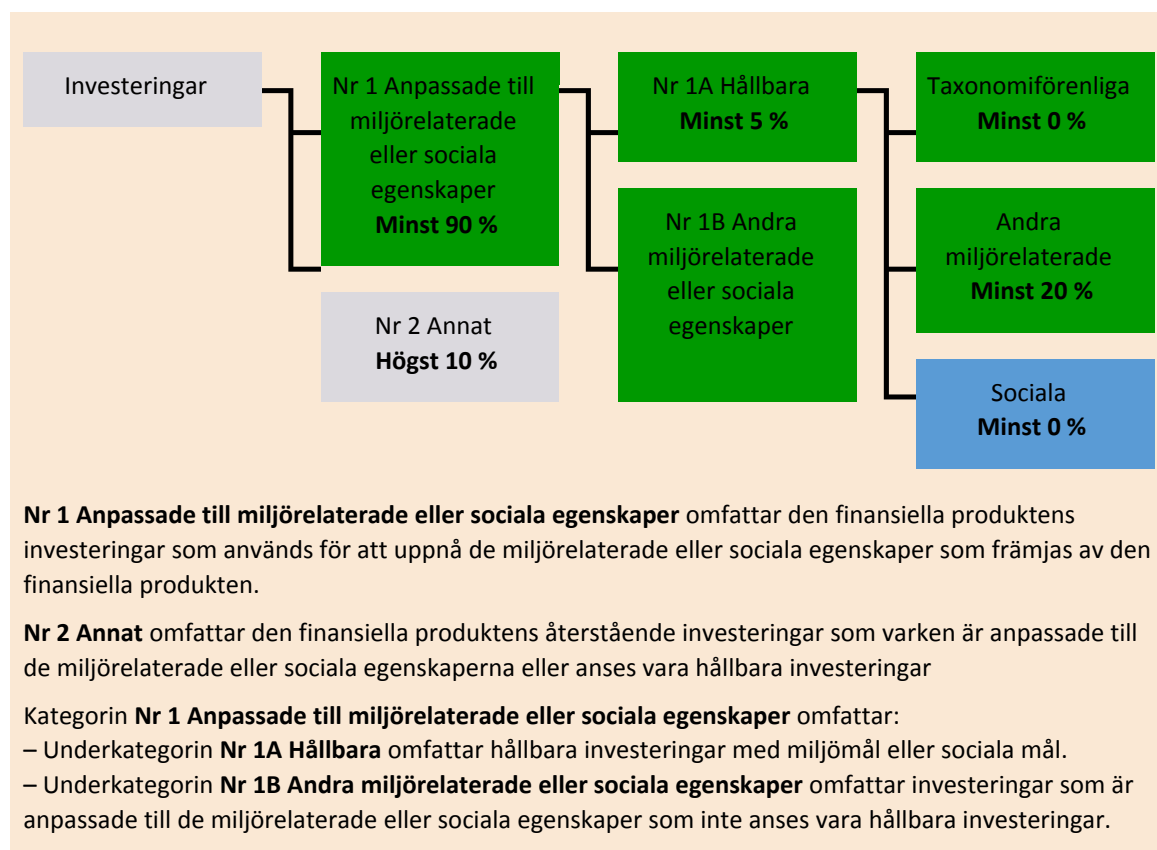
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 5 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

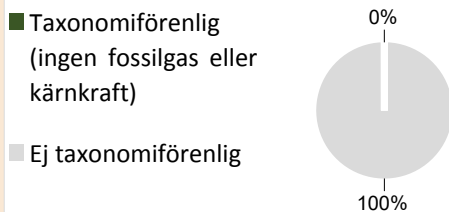
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

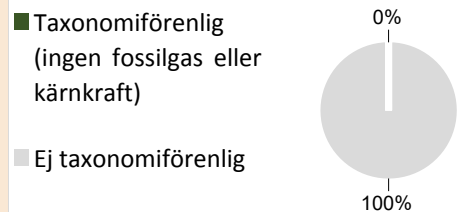
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI JAPAN Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapper för stora och medelstora bolag på den japanska marknaden. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI USA SRI PAB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

549300W0L1QTBIEUXI22

## 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 % 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

### ☒ 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<sub>2</sub>) dividerat med företagsvärdet inklusive konstanter.

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 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 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 det överordnade indexet.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning**

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI USA SRI Filterd PAB Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI USA SRI Filterd 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 viktat 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).

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltd börsnoterad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI USA SRI Filterd 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 Filterd 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 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 det överordnade indexet.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

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?***

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

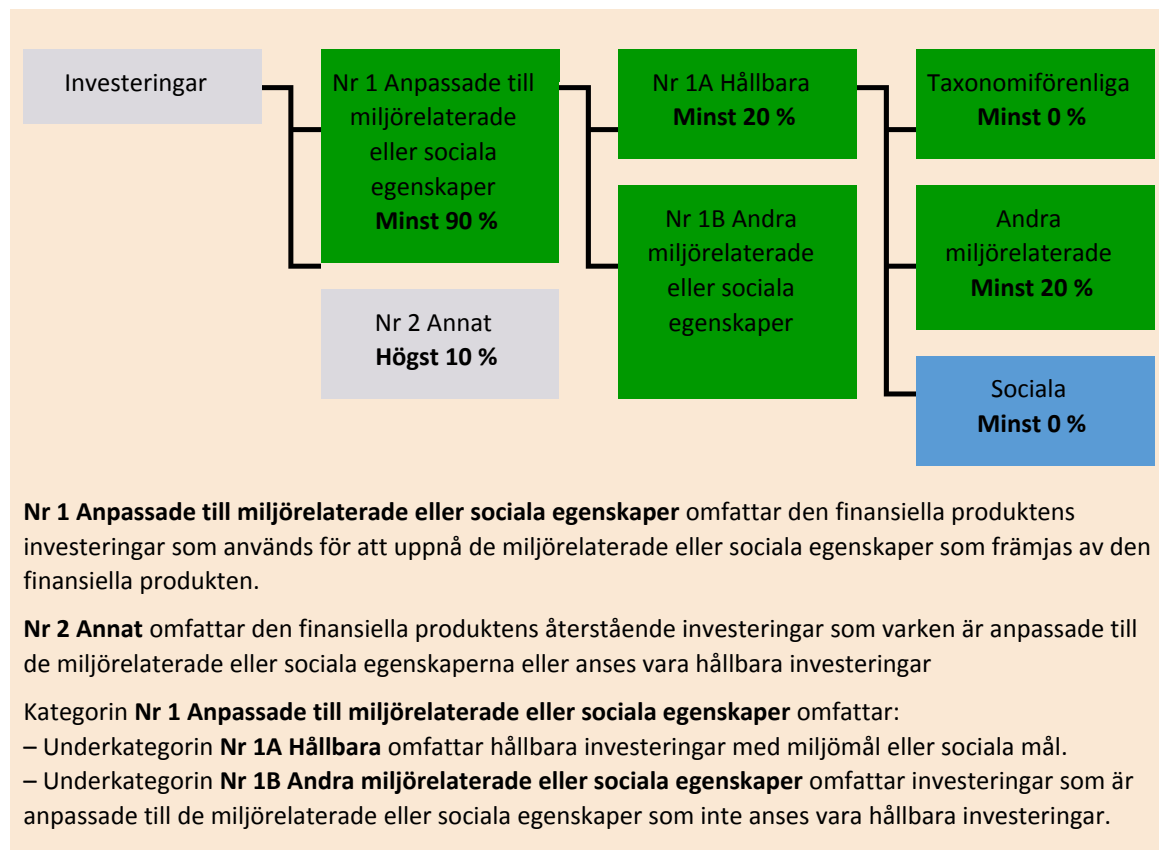
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

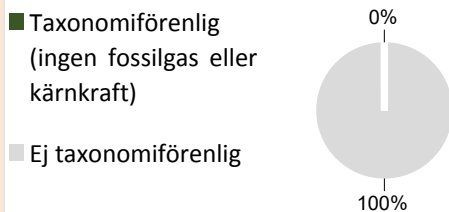
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

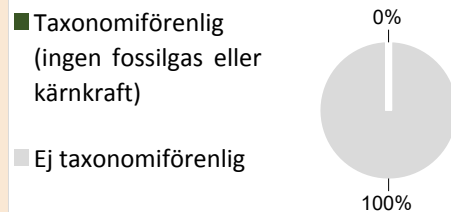
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI USA SRI Filterd 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 viktat 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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).

Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI WORLD SRI PAB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

54930067TT873B9E5C67

## 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 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 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

### **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<sub>2</sub>) 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 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 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 det överordnade indexet.

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-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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaldade 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin må, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### 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 ("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 viktat om

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

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).

● ***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 förvaltdad 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 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 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 det överordnade indexet.

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-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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

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?**

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

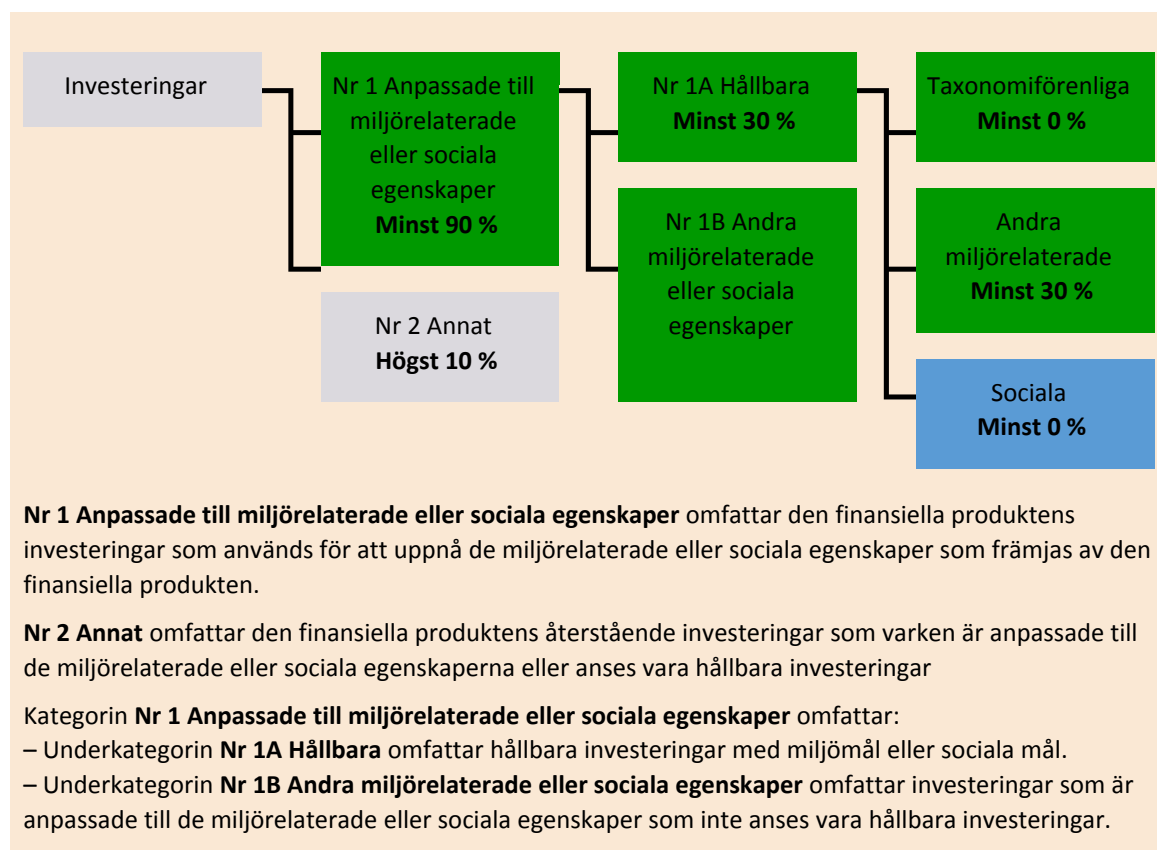
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 30 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

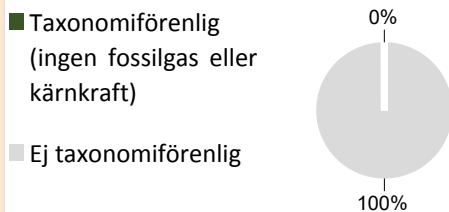
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

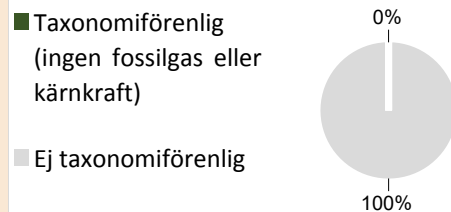
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI World SRI Filtered PAB Index 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 viktat 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](http://www.amundietf.com).



Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y

#### Identifieringskod för juridiska personer:

5493003U13Y6UYB5XW65

## 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 % 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). 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).

● ***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 Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year 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](https://www.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](http://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 förvaldade 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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index är ett obligationsindex som motsvarar obligationer som är noterade i euro med höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (överordnat index), med återstående löptid på 0 eller 3 år och som

risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

använder ytterligare sektor- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year 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 [bloombergingredients.com](https://www.bloombergingredients.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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

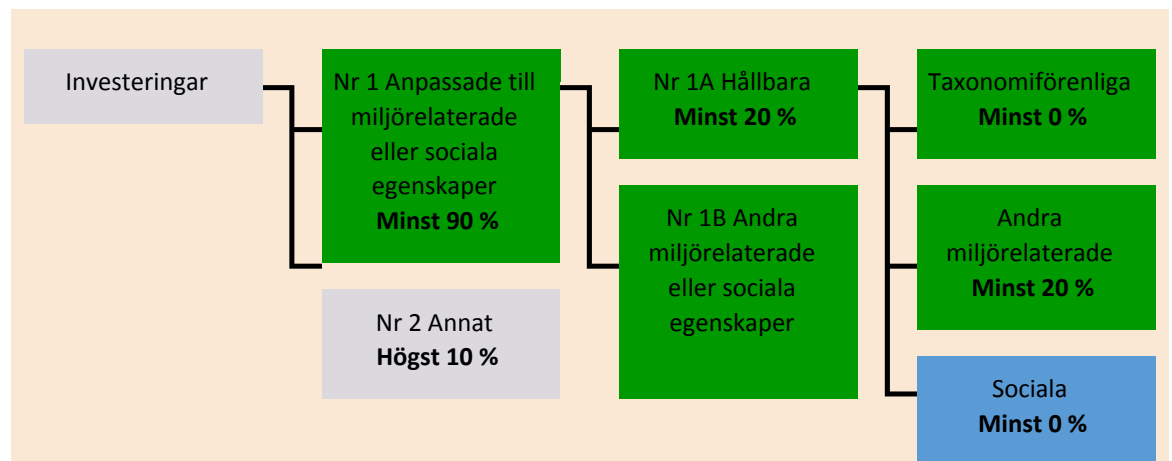
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar den finansiella produkten investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.

**Nr 2 Annat** omfattar den finansiella produkten 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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

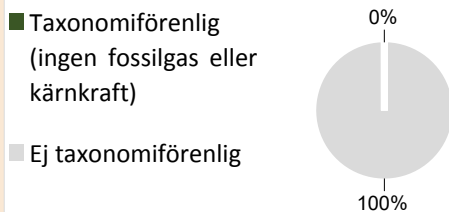
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

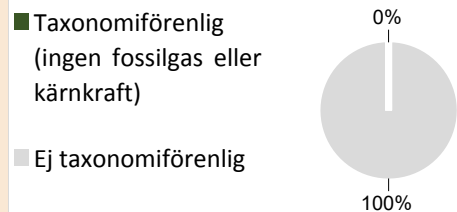
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG BBB+ Sustainability SRI 0-3 Year Index är ett obligationsindex som motsvarar obligationer som är noterade i euro med höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index ("överordnat index"), med återstående löptid på 0 eller 3 år som använder ytterligare sektorkriterier, miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier 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](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI EMERGING MARKETS SRI PAB

#### 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 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 % 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

### **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<sub>2</sub>) 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 (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 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 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 det överordnade indexet. 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin må, 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filterd PAB Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filterd PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets Index ("överordnat index"), 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

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

viktat 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).

● ***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 förvaltat börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filterd 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 Filterd 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 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 det överordnade indexet. 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

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?***

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

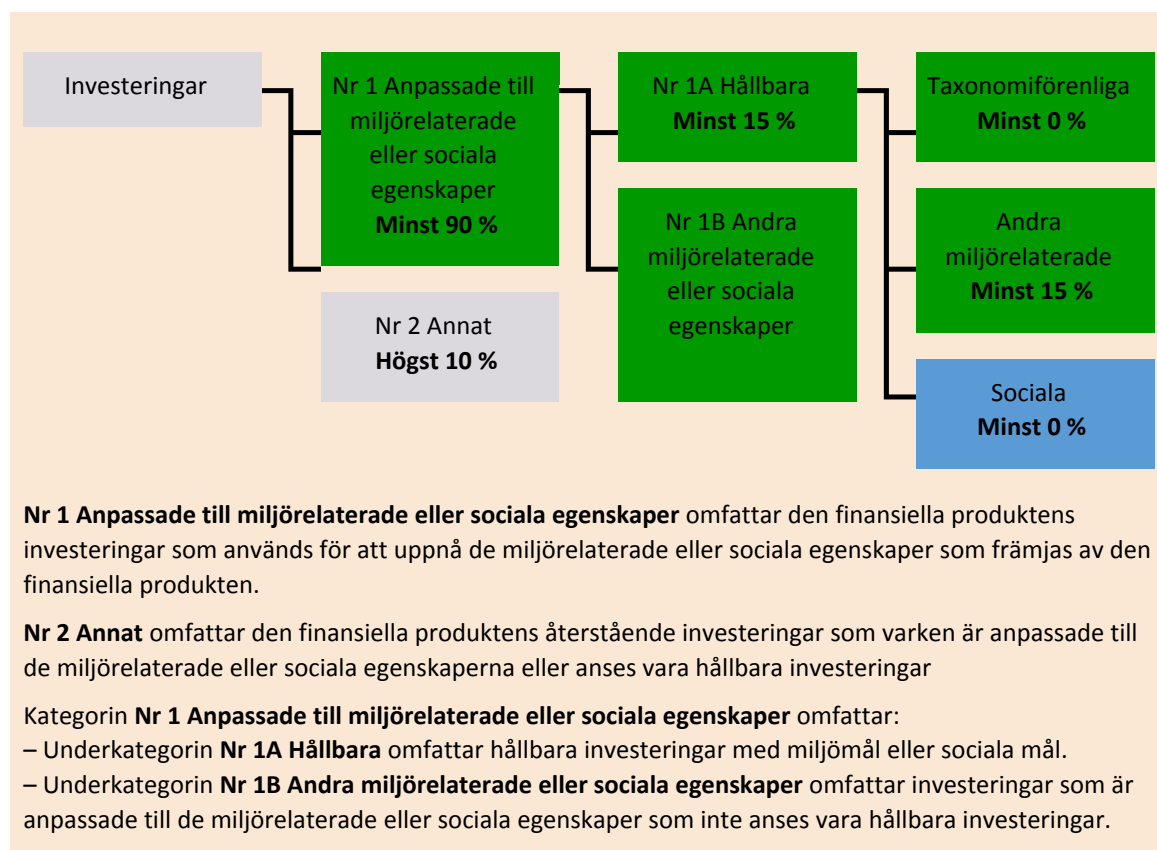
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

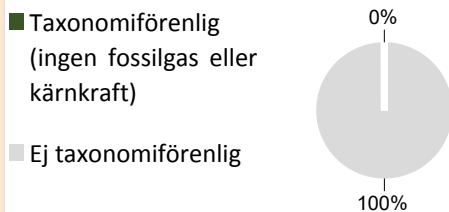
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

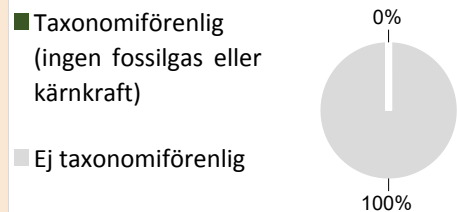
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EM (Emerging Markets) SRI Filterd PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets Index ("överordnat index"), 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 viktat 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI NORTH AMERICA ESG BROAD CTB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

2221009K64OHGR108Z36

## 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 % 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 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.

### ☒ 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<sub>2</sub>) 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 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 är involverade i affärsverksamhet som enligt MSCI ESG Research\*, däribland kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olje- & gasborrning 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 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. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaltrade 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning**

### 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.

MSCI North America ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI North America Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepappren för stora och medelstora bolag på den amerikanska och kanadensiska marknaden. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. 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).

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltd 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 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 (EU CTB) samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som moderindexet.

Först utesluts värdepapper från företag som är involverade i affärsverksamhet som enligt MSCI ESG Research\*, däribland kärnvapen, tobak, kontroversiella vapen, oljesand, termiskt kol och/eller okonventionell olje- & gasborrning 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 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. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

Varje akties vikt i indexet bestäms av optimeringsprocessen för att uppfylla de ovan nämnda begränsningarna.

Den maximala vikten en aktie kan ha i indexet anges som vikten av denna aktie i det överordnade indexet + 2 %.

\*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.

● ***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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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:

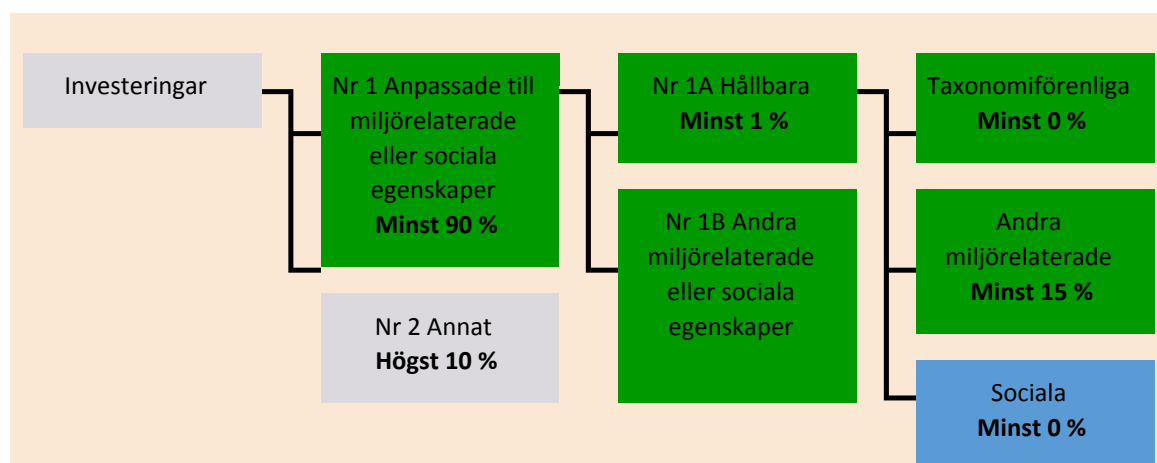
- **omsättning**, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

## Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar. Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

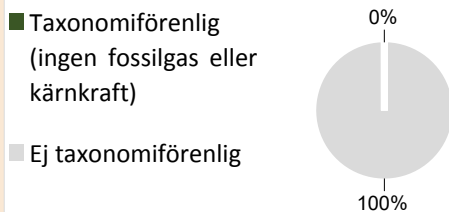
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

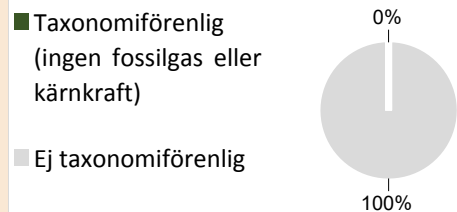
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

MSCI North America ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI North America Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepappren för stora och medelstora bolag på den amerikanska och kanadensiska marknaden. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX MSCI EM ASIA SRI PAB

#### 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 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 % 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

### **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<sub>2</sub>) dividerat med företagsvärdet inklusive konstanter.

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 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 det överordnade indexet.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 högentensiva 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EM Asia SRI Filterd PAB Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EM Asia SRI Filterd PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets (EM) ("överordnat index"), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag i nio asiatiska 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 viktat om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med klimatomställningen

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

### ● 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 förvaltnad 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 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 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 det överordnade indexet.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

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?

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

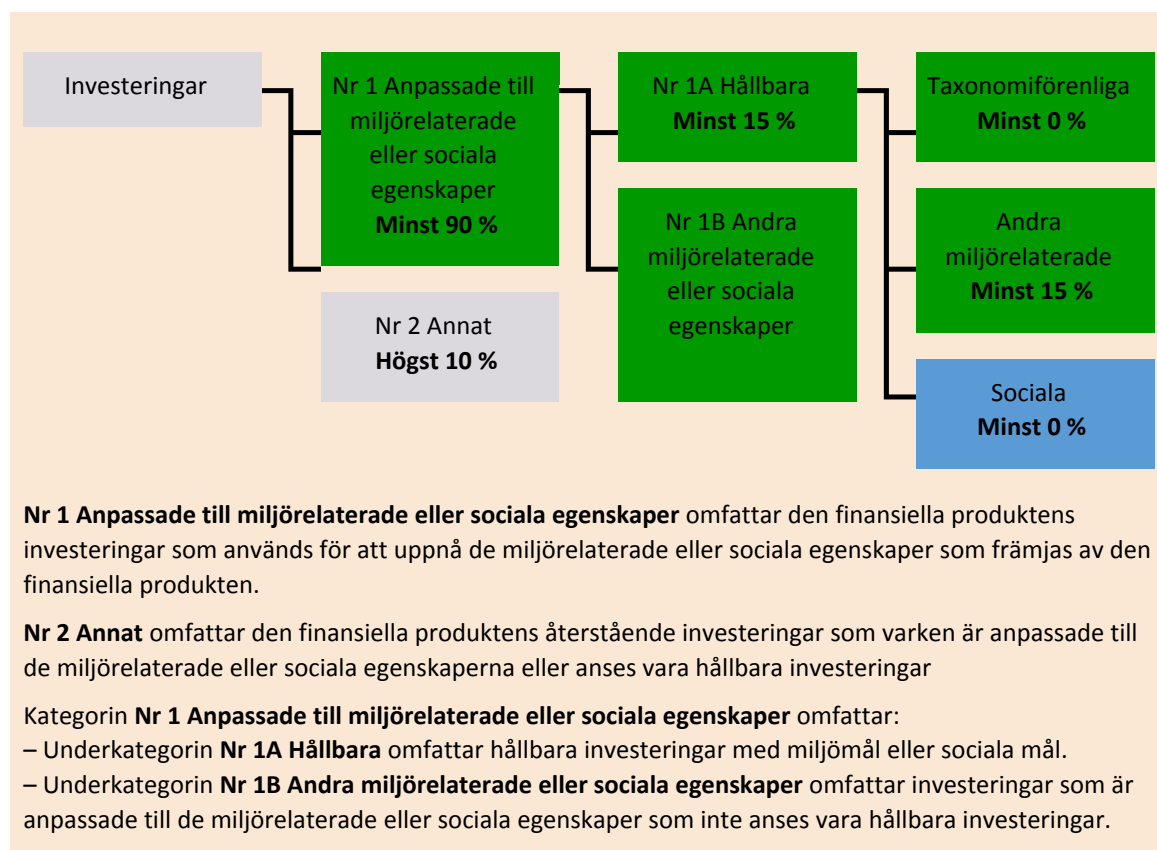
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

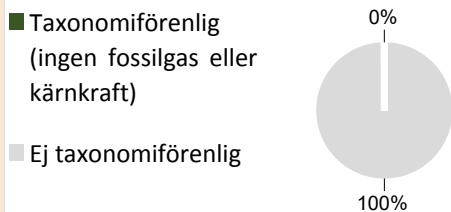
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

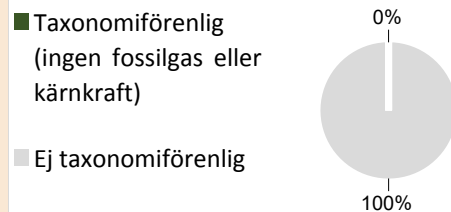
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EM Asia SRI Filterd PAB Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Emerging Markets (EM) ("överordnat index"), som motsvarar aktier i stora och medelstora företag i nio asiatiska 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 viktat 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800CMYD4SG29DTC94

## 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 10 % 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). 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).

● ***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 Leaders 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 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 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 det överordnade 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](http://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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonominns 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped Index 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.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI EM ESG Leaders 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 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 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 det överordnade indexet.

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?***

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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde. 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 kommer att uppfylla 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.

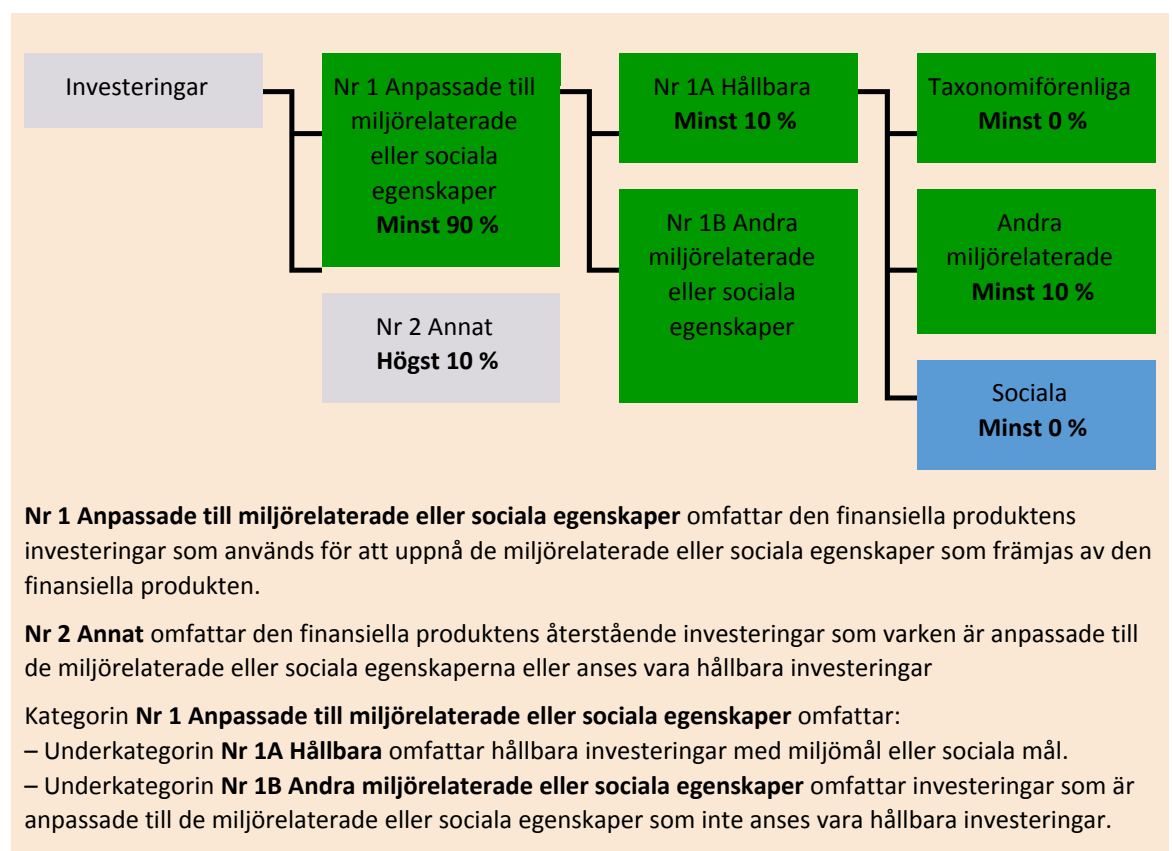
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 (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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 10 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

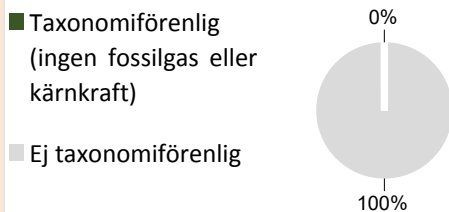
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

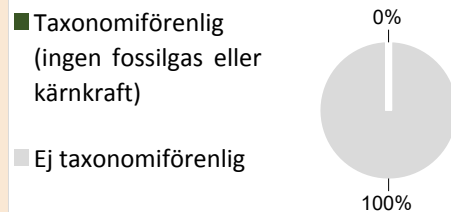
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EM ESG Leaders 5% Issuer Capped Index 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.

● ***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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI EURO CORP 0-1Y ESG

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800LLBNM6TDFBXD07

## 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 % 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). 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).

● ***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](https://www.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](http://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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### 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 investment grade-obligationer denominerade i euro, obligationer med fast ränta som emitterats av privata bolag (så kallade företagsobligationer) med återstående löptid mellan en månad och ett år och som tillämpar



risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

ytterligare sektor- och ESG-kriterier för valbarhet av värdepapper.

● ***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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

IBoxx 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

- 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](https://www.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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

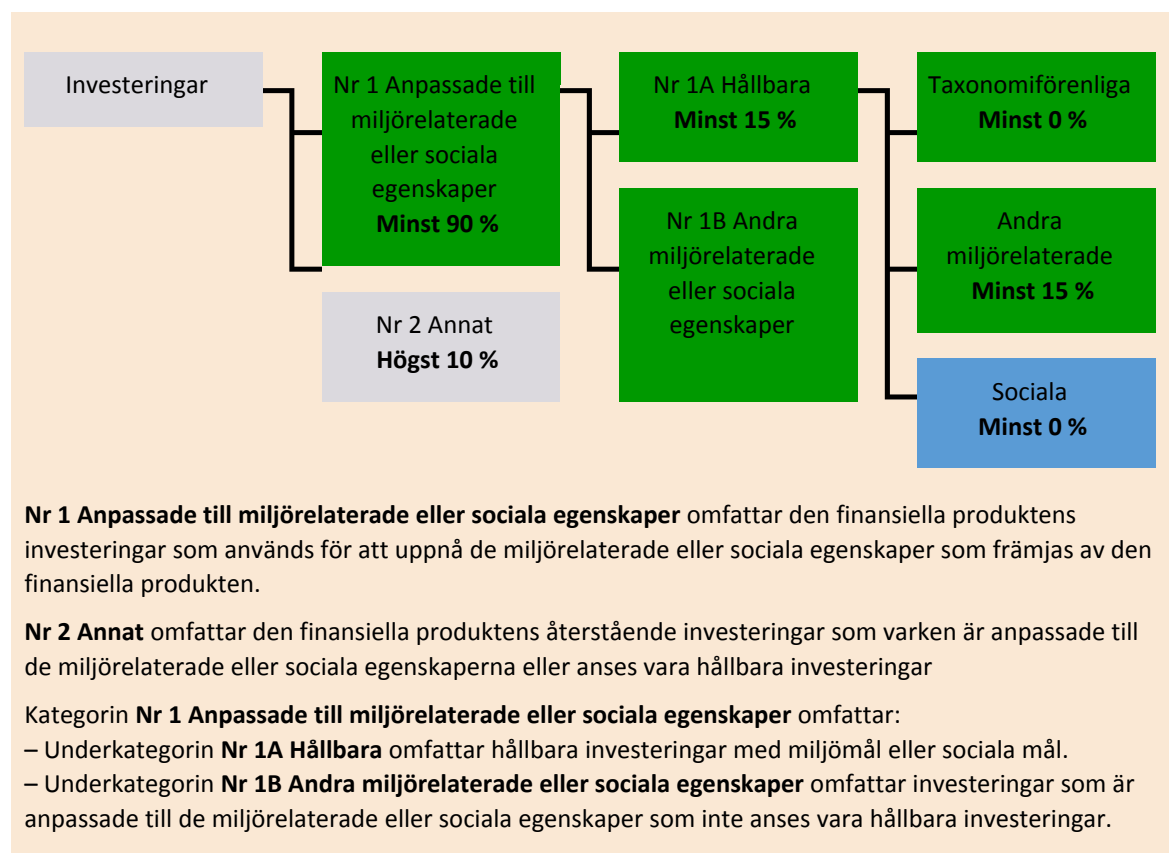
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

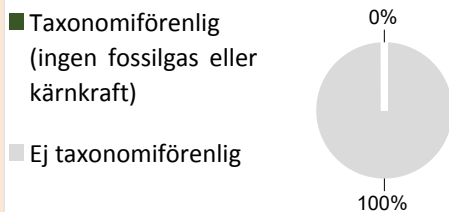
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

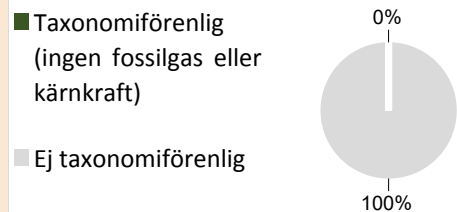
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

iBoxx MSCI ESG EUR Corporates 0-1 TCA Index är ett obligationsindex som är representativt för investment grade-obligationer denominerade i euro, obligationer med fast ränta som emitterats av privata bolag (så kallade företagsobligationer) med återstående löptid mellan en månad och ett år och som tillämpar ytterligare sektor- och ESG-kriterier för valbarhet av 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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND ESG LEADERS

#### 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 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 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 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). 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).

● ***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 MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe ex Switzerland Index ("moderindexet") och som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 14 länder med utvecklade marknader i Europa (per maj 2022) utom Schweiz, som är emitterade av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

Det tillämpliga investeringsområdet 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 eller över "BB" och ett MSCI ESG-kontroversbetyg\*\*\* på eller över "3" 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 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 det överordnade indexet.

Varje företag viktas i proportion till sitt börsvärde, justerat för fritt omsättbara aktier, och begränsas till 5 %.

\*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 företags 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](http://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 förvaldade 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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

Bli rentvård 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu)

Nej



### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe ex Switzerland Index ("moderindexet") som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 14 länder med utvecklade marknader i Europa (per maj 2022), utom Schweiz, som är emitterade av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

### ● 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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe ex Switzerland Index ("moderindexet") som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 14 länder med utvecklade marknader i Europa (per maj 2022), utom Schweiz, som är emitterade av företag som har högsta betyg avseende miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) inom varje sektor i moderindexet.

Det tillämpliga investeringsområdet 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 eller över "BB" och ett MSCI ESG-kontroversbetyg\*\*\* på eller över "3" 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 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 det överordnade indexet.

Varje företag viktas i proportion till sitt börsvärde, justerat för fritt omsättbara aktier, och begränsas till 5 %.

\*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 företagens verksamhet, produkter och tjänster.

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?***

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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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:

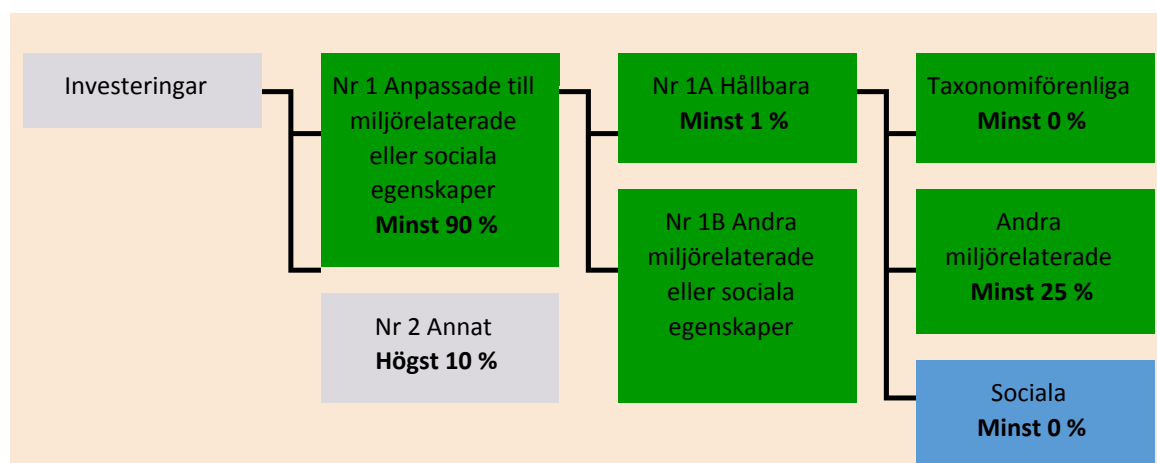
- **omsättning**, vilket återspeglar andelen intäkter från investeringsobjektens gröna verksamheter
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

## Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar. Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar den finansiella produkts investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.

**Nr 2 Annat** omfattar den finansiella produkts 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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

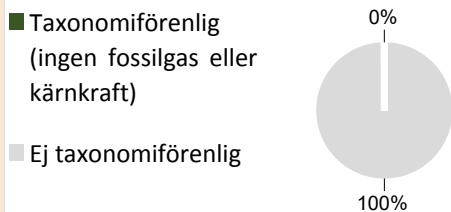
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

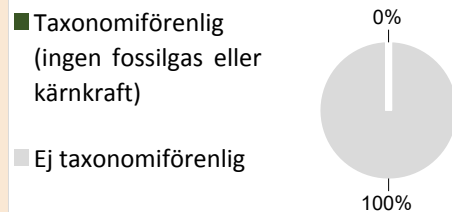
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

MSCI Europe ex Switzerland ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index är ett aktieindex baserat på MSCI Europe ex Switzerland Index ("moderindexet") som är representativt för aktier i stora och medelstora företag i 14 länder med utvecklade marknader i Europa (per maj 2022), utom Schweiz, som är 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](http://www.amundiETF.com).

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX EURO AGG SRI

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800MNGINQA3GWTZ79

## 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 % 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). 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).

● ***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 Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral 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-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](https://www.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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI Euro Aggregate Sustainable SRI Sector Neutral Index är ett obligationsindex som

på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

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.

● ***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 förvaltnad 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](https://www.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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.



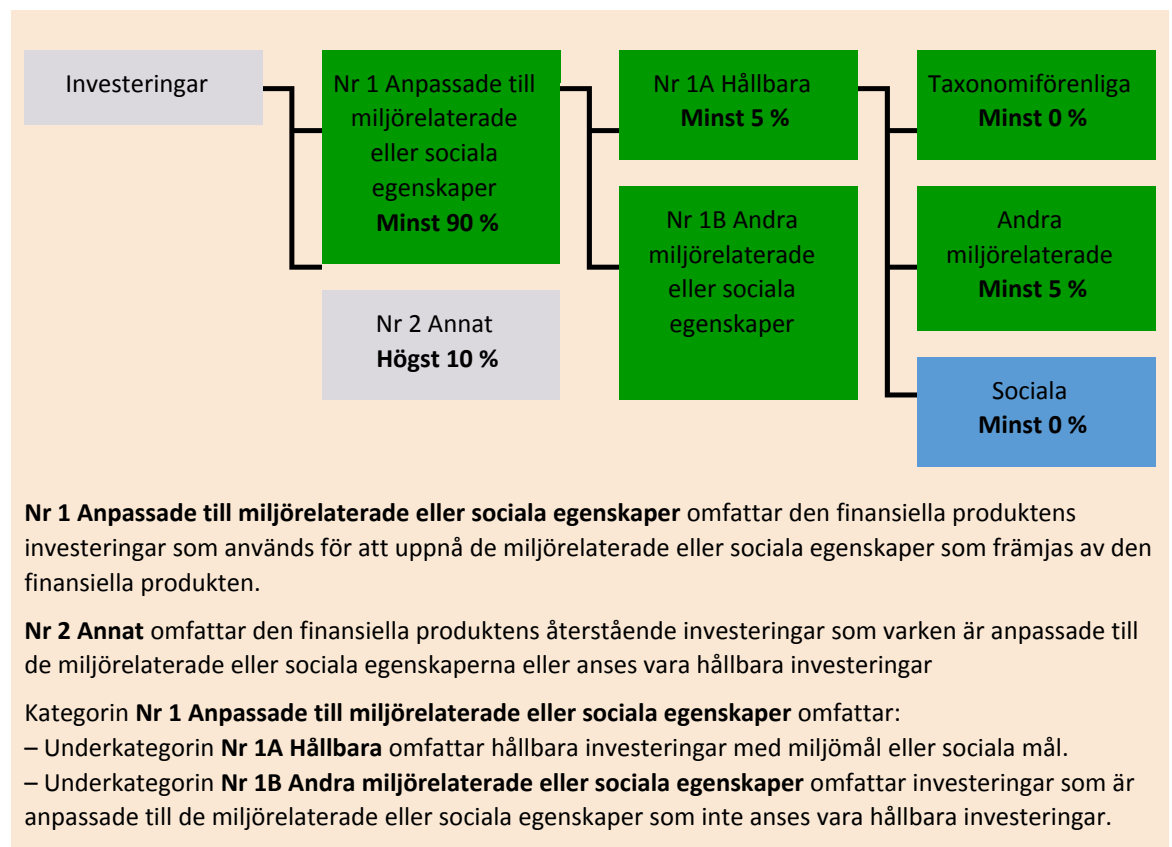
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 5 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

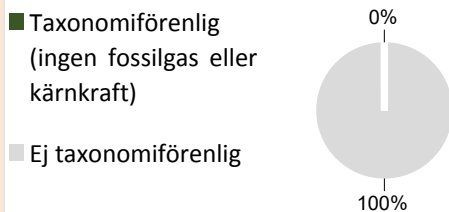
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

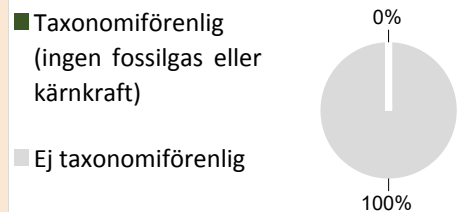
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 45 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att förbinda 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?

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 ("överordnat index") och använder sektorkriterier, miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier 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](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI S&P 500 ESG

Identifieringskod för juridiska personer:

222100YTW62AGYBTTC41

## 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 % 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).

☒ **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 Sustainable<sup>1</sup> Research, tillhandahåller tillsammans betyg för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) (gemensamt kallade S&P DJI ESG-betyg), som mäter företagets 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 DJI 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 ESG+ 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](http://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 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 "presterar bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presterar bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presterar 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. investeringsobjektets 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

emitterter 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-taxonomi fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

☐ Nej



### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för S&P 500 ESG+ Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

S&P 500 ESG+ Index ("indexet") är ett brett index, viktat enligt ett tak för börsvärde, som mäter utvecklingen för värdepapper som uppfyller hållbarhetskriterier, samtidigt som det bevarar en sammantagen branschgruppsviktning som den i S&P 500 ("moderindexet"). S&P500 Index är ett aktieindex som är representativt för ledande värdepapper som handlas i USA.

### ● 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det initiala investeringsområdet för S&P 500 ESG+ 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, borrhning 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](http://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.

### ● 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

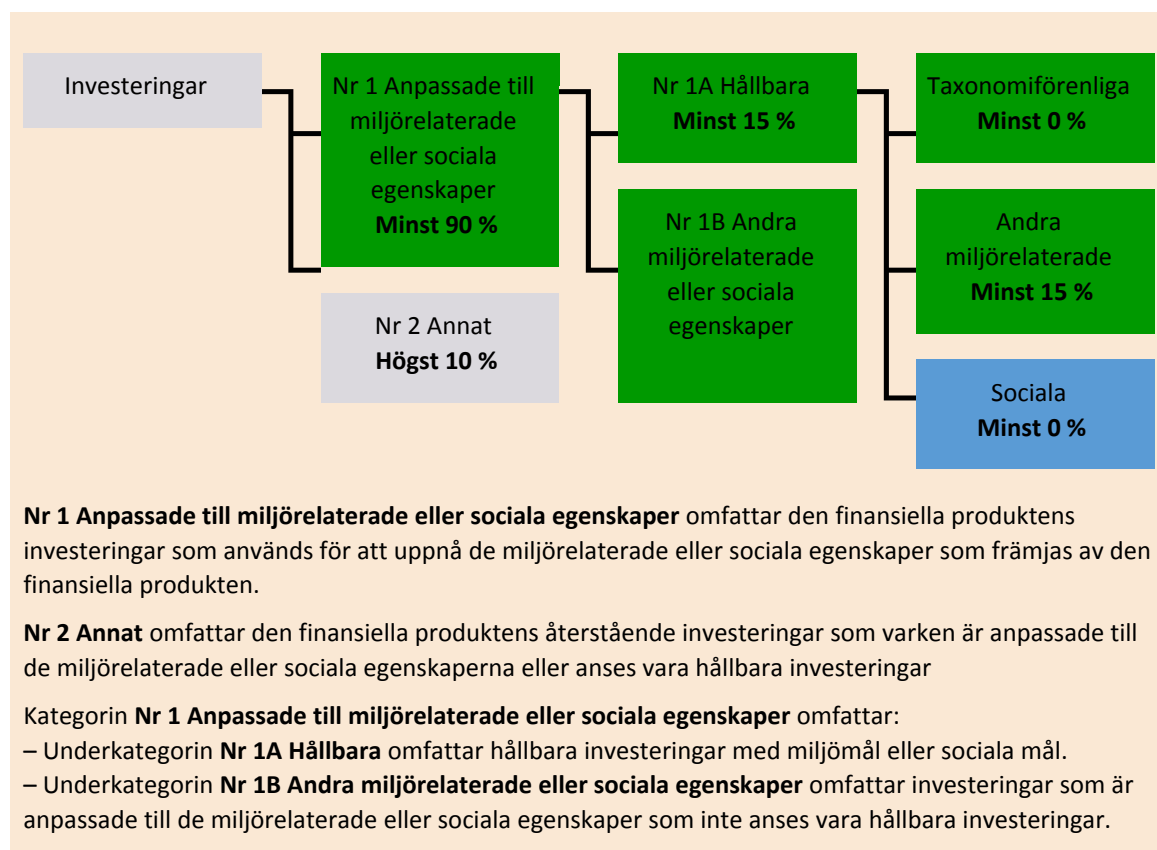
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



### Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

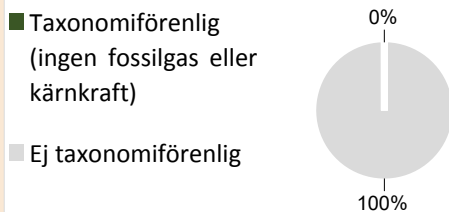
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

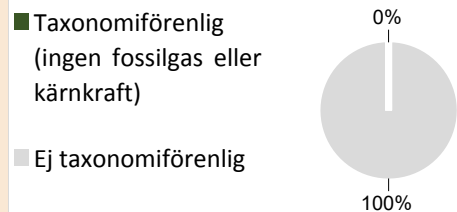
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

S&P 500 ESG+ Index ("indexet") är ett brett index, viktat enligt ett tak för börsvärde, som mäter utvecklingen för värdepapper som uppfyller hållbarhetskriterier, samtidigt som det bevarar en sammantagen branschgruppsviktning som den i S&P 500 ("moderindexet"). S&P500 Index är ett aktieindex som är representativt för 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.amundi-etf.com](http://www.amundi-etf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI GLOBAL CORP SRI 1-5Y

#### Identifieringskod för juridiska personer:

222100AVKM1M7Q2EFT37

## 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 % 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). 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).

● ***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 Global Corporate ESG Sustainability SRI 1–5 Year 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](https://www.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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

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.

risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI Global Corporate ESG Sustainability SRI 1-5 Year 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](https://www.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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

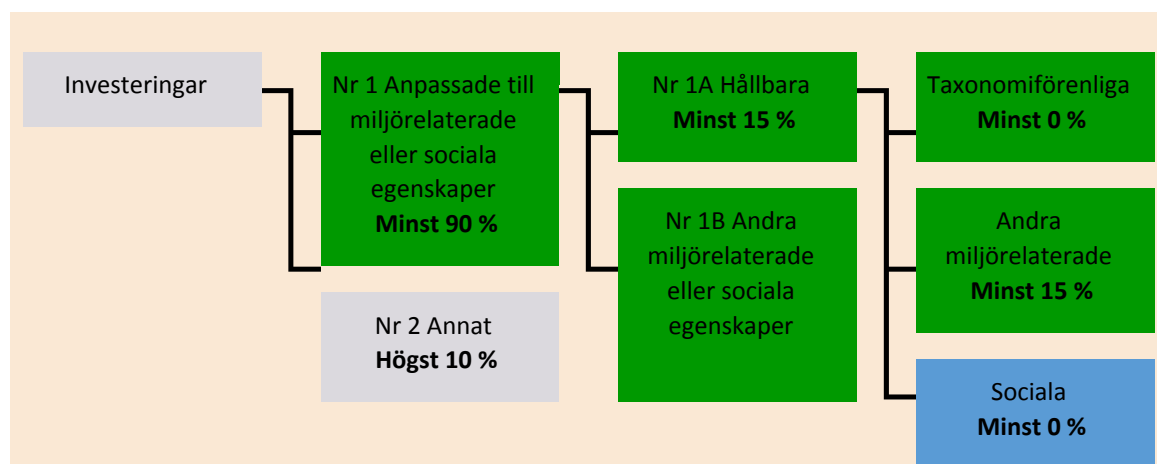
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar den finansiella produkts investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.

**Nr 2 Annat** omfattar den finansiella produkts 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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

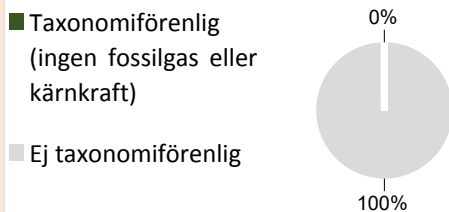
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

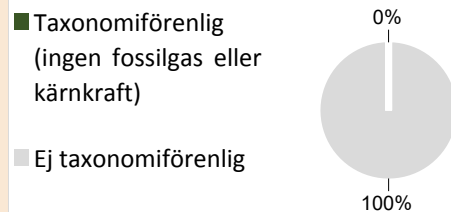
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

Amundi Stoxx Europe 600 ESG

#### Identifieringskod för juridiska personer:

549300JX3L7U61W4HF88

## 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 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 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).

### **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](https://www.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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

#### 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 (moderindex) 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.

#### 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 förvaltnad 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 (moderindex) 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](https://www.stoxx.com) för mer information om kontroversiella verksamheter och om urvalet.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?***

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 kommer att uppfylla 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.

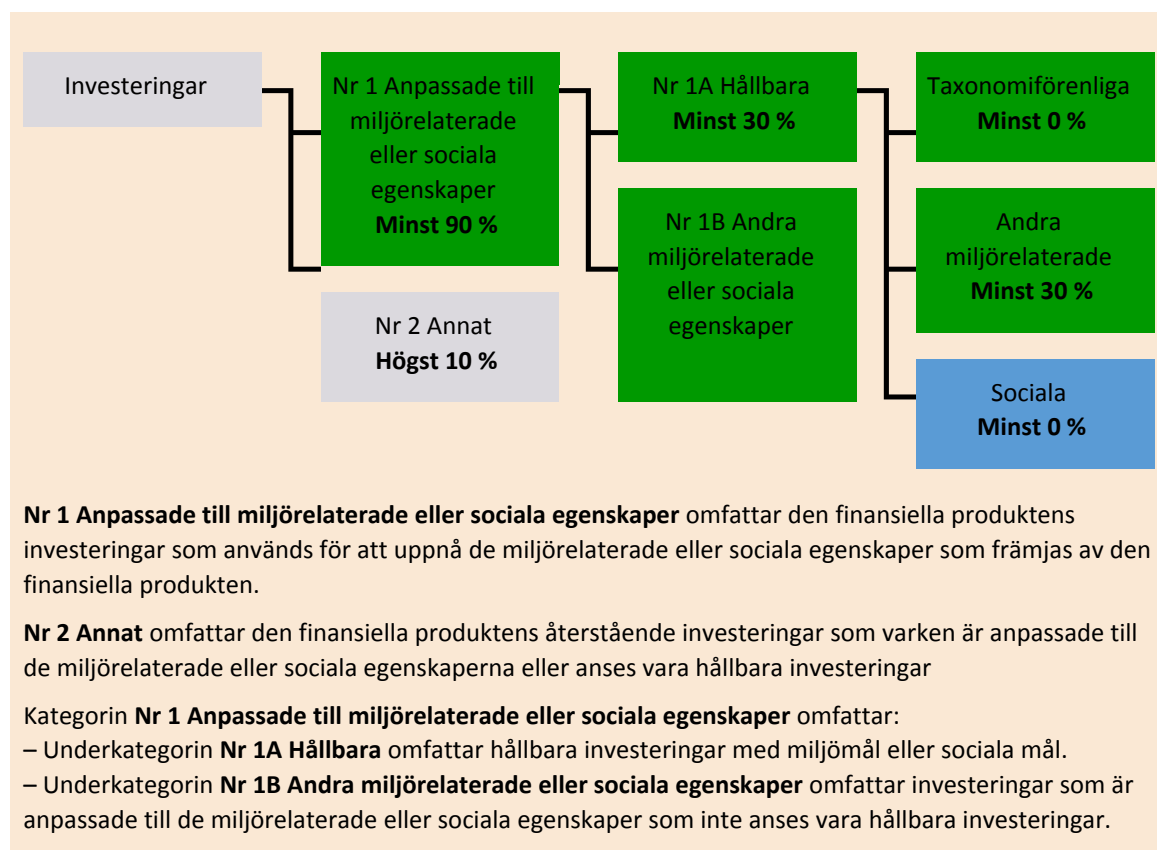
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 30 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

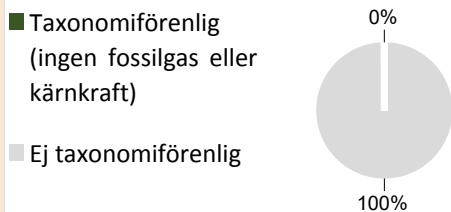
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

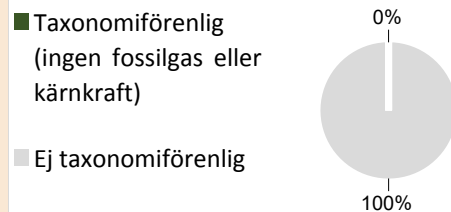
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

STOXX EUROPE 600 ESG+ Index är ett aktieindex som är baserat på Stoxx Europe 600 (moderindex) 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](http://www.amundietf.com).



**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND

**Identifieringskod för juridiska personer:**

54930086L1BR8DOJL973

**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 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 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](http://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.

● ***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 300 miljoner euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro. Förteckningen över länder som får tas med i indexet ses över årligen.
- 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.

● ***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

Huvudsakliga negativa konsekvenser är investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

obligationerna övervikts 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-taxonominns 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 övervikts 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

**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och  
risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

procentandel är allokerad till icke-gröna obligationer, och riskprofilerna för indexet och moderindexet är jämförbara.

● ***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 förvaltnad 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 300 miljoner euro och är emitterade av länder i euroområdet med emissioner på minst 50 miljarder euro. Förteckningen över länder som får tas med i indexet ses över årligen.

– 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.

● ***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.



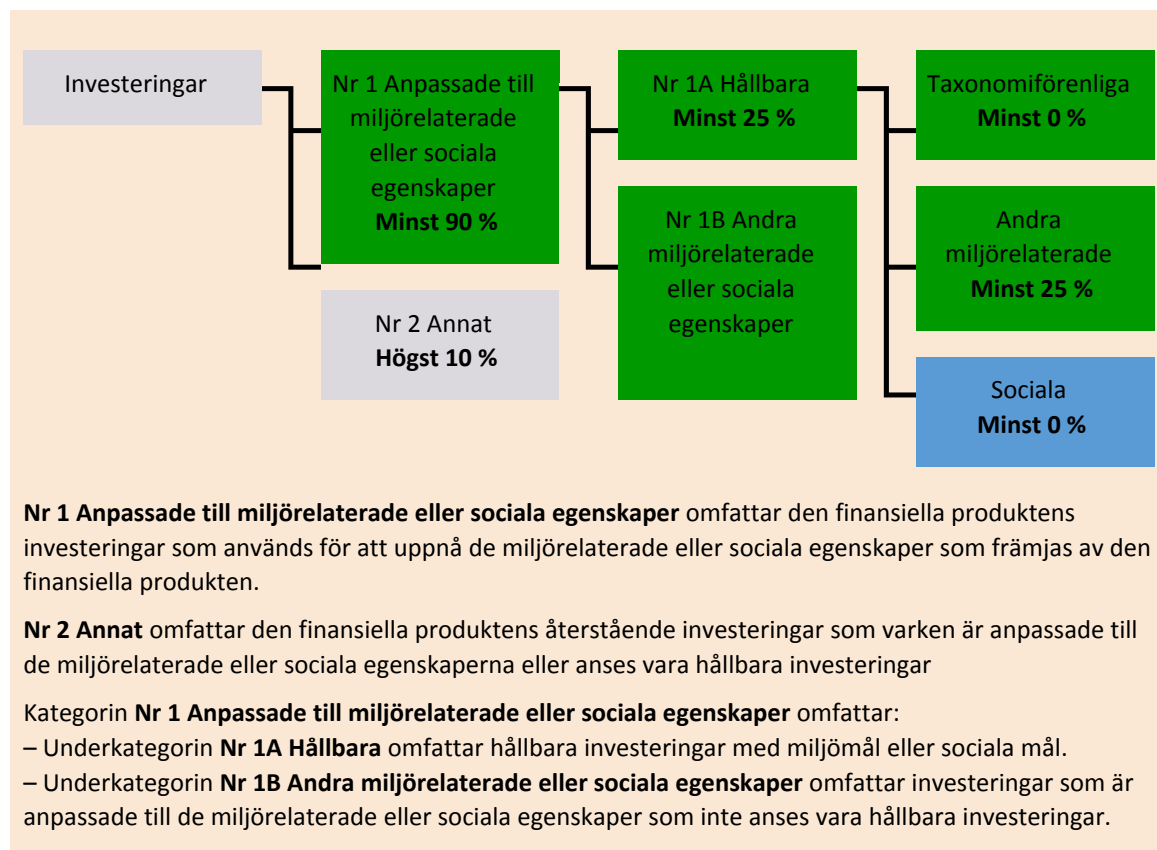
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

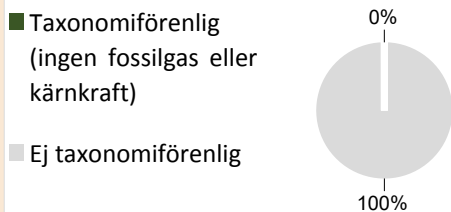
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

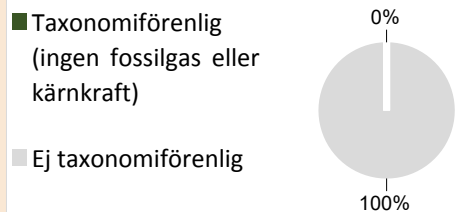
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 0 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljriskhantering.



**Referensvärden** är index som mäter om de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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, Bloomberg Euro Treasury 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 anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?***

Enligt tillämpliga regler för indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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](http://www.amundietf.com).

### Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI

#### Identifieringskod för juridiska personer:

2221000A7N8FW0MB1V42

## 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 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 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). 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).

● ***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 Euro Corporate ESG Sustainability SRI 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](https://www.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](http://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 förvaldade 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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin**  
styr investeringsbeslut  
på grundval av faktorer  
som investeringsmål och

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

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 (överordnat index) och använder sektorkriterier och

risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

ytterligare ESG-kriterier för värdepappersurval.

● ***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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI 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 [bloombergingredients.com](https://www.bloombergingredients.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.

● ***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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

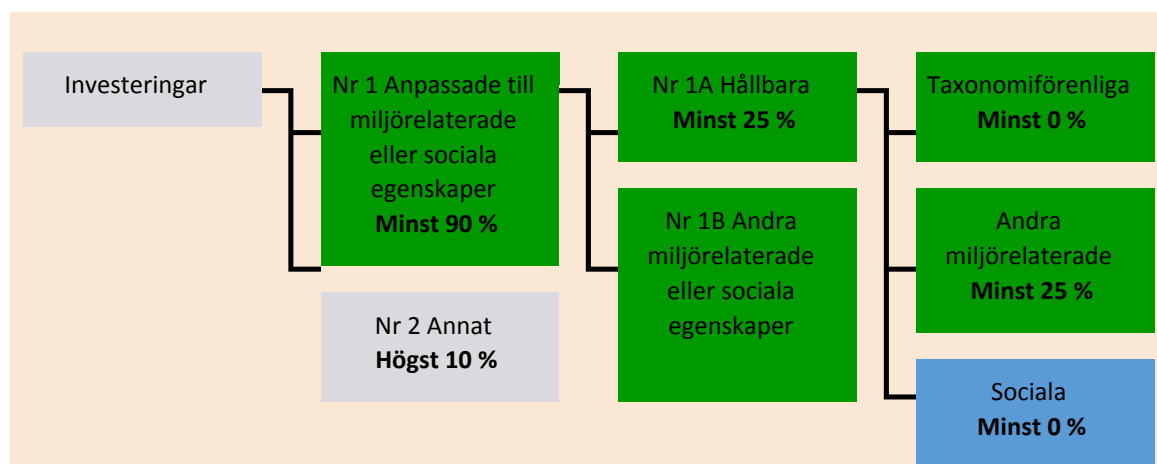
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 25 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar den finansiella produkten investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.

**Nr 2 Annat** omfattar den finansiella produkten 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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

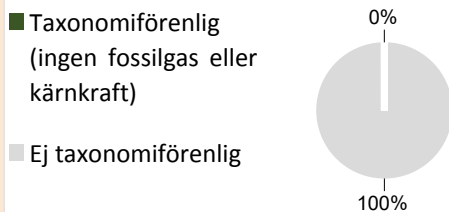
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

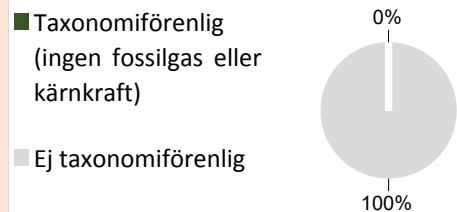
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

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 ("överordnat index") och använder sektorkriterier och ytterligare miljökriterier, sociala kriterier och bolagsstyrningskriterier 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](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI WORLD CLIMATE TRANSITION CTB

#### Identifieringskod för juridiska personer:

222100479LWJEIXZB875

## 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 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 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.

### **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<sub>2</sub>) 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 strävar MSCI World Climate Change CTB Select Index ("indexet") efter att minska sin växthusgasintensitet med minst 30 % jämfört med moderindexet och är avsett att uppfylla målet att minska koldioxidutsläppen med 7 % jämfört med föregående år. Indexet konstrueras enligt följande:

- Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla befintliga beståndsdelar i moderindexet (dvs. aktier i medelstora och stora bolag som motsvarar 85 % av det totala börsvärdet för det geografiska område som moderindexet omfattar).

- Det initiala investeringsområdet konstrueras genom att utesluta värdepapper från det tillämpliga investeringsområdet baserat på följande kriterier:

1. Företag utan kreditbetyg: företag som inte har fått något kreditbetyg från MSCI ESG Research for Low Carbon Transition Assessment.
2. Företag som är verksamma inom kontroversiella vapen, enligt definitionen i metoden för MSCI Ex Controversial Weapons Indexes.

Varje återstående företag viktas enligt sitt börsvärde och sin sammanlagda poäng från Low Carbon Transition (LCT)\* och koldioxidintensitet för att öka exponeringen mot företag som tar del av möjligheter i samband med klimatomställningen och minska exponeringen mot företag som utsätts för risker i samband med klimatomställningen.

- Det godtagbara investeringsområdet konstrueras utifrån det initiala investeringsområdet genom att utesluta värdepapper baserat på följande kriterier:

1. Företag som har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor,
2. Företag som är verksamma inom tobak och elproduktion baserad på kol och termiskt kol.

– Både moderindexet och det godtagbara investeringsområdet delas in i två områden: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan".

– Det slutliga investeringsområdet konstrueras utifrån det godtagbara investeringsområdet genom viktning: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan" i enlighet med deras respektive allokeringar i moderindexet och värdepapperen baserat på deras mål och åtaganden att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för klimatomställning. Varje värdepappers vikt i indexet begränsas till 4 %.

### **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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 högentensiva 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för MSCI World Climate Change CTB Select Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI World Climate Change CTB Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindexet"), som är representativt för marknaderna med stora och medelstora bolag i 23 utvecklade länder (per december 2020). Indexet syftar till att representera resultatet för en strategi som viktat 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).



**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI World Climate Change CTB Select Index ("indexet") strävar efter att minska sin växthusgasintensitet med minst 30 % jämfört med moderindexet och är avsett att uppfylla målet att minska koldioxidutsläppen med 7 % jämfört med föregående år. Indexet konstrueras enligt följande:

- Det tillämpliga investeringsområdet omfattar alla befintliga beståndsdelar i moderindexet (dvs. aktier i medelstora och stora bolag som motsvarar 85 % av det totala börsvärdet för det geografiska område som moderindexet omfattar).

- Det initiala investeringsområdet konstrueras genom att utesluta värdepapper från det tillämpliga investeringsområdet baserat på följande kriterier:

1. Företag utan kreditbetyg: företag som inte har fått något kreditbetyg från MSCI ESG Research for Low Carbon Transition Assessment.

2. Företag som är verksamma inom kontroversiella vapen, enligt definitionen i metoden för MSCI Ex Controversial Weapons Indexes.

Varje återstående företag viktas enligt sitt börsvärde och sin sammanlagda poäng från Low Carbon Transition (LCT)\* och koldioxidintensitet för att öka exponeringen mot företag som tar del av möjligheter i samband med klimatomställningen och minska exponeringen mot företag som utsätts för risker i samband med klimatomställningen.

- Det godtagbara investeringsområdet konstrueras utifrån det initiala investeringsområdet genom att utesluta värdepapper baserat på följande kriterier:

1. Företag som har varit inblandade i mycket allvarliga kontroverser gällande ESG-frågor,

2. Företag som är verksamma inom tobak och elproduktion baserad på kol och termiskt kol.

– Både moderindexet och det godtagbara investeringsområdet delas in i två områden: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan".

– Det slutliga investeringsområdet konstrueras utifrån det godtagbara investeringsområdet genom viktning: "hög klimatpåverkan" och "låg klimatpåverkan" i enlighet med deras respektive allokeringar i moderindexet och värdepapperen baserat på deras mål och åtaganden att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för klimatomställning. Varje värdepappers vikt i indexet begränsas till 4 %.

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 policyen för att bedöma praxis för god styrning för investeringsobjekten?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

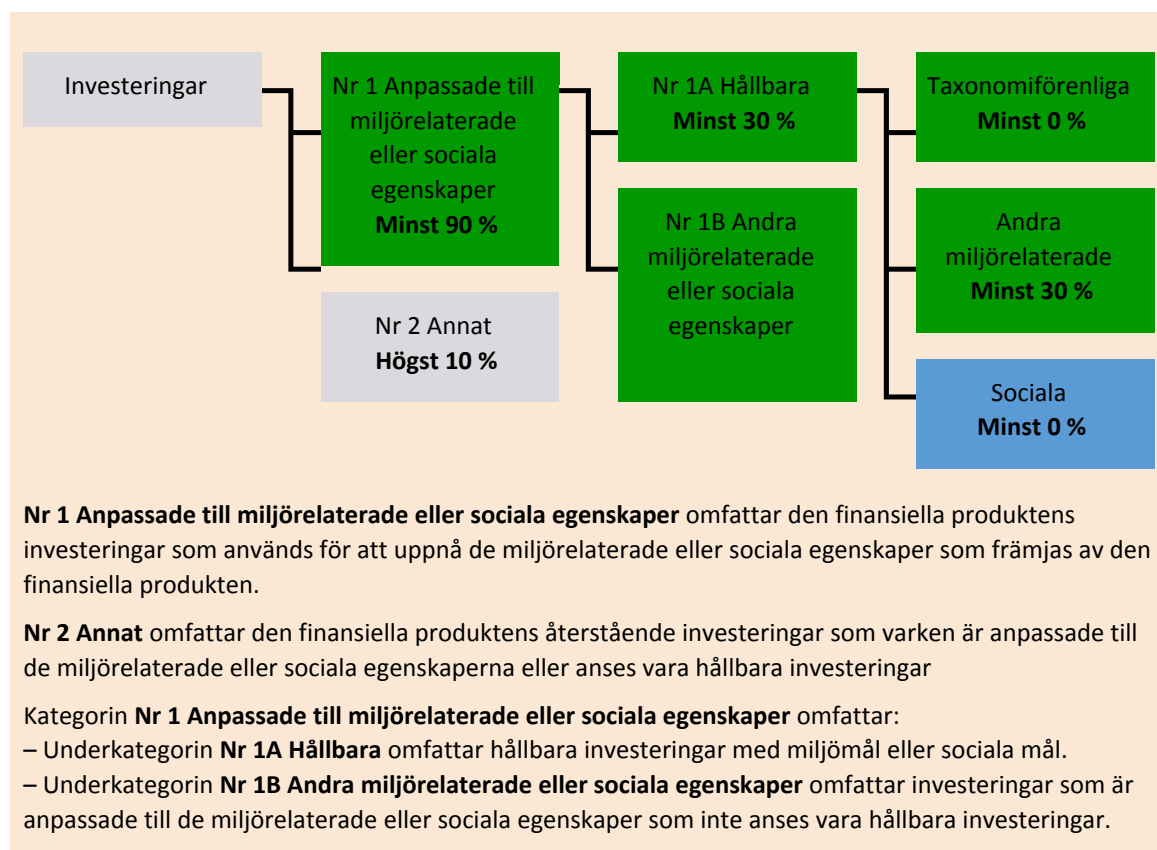
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 30 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

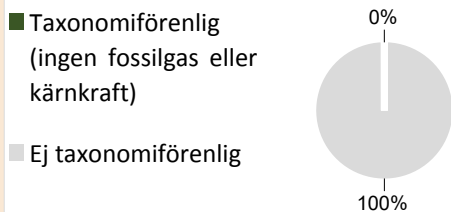
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

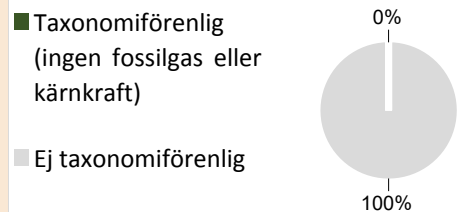
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI World Climate Change CTB Select Index är ett aktieindex baserat på MSCI World Index ("moderindexet"), som är representativt för marknaderna med stora och medelstora bolag i 23 utvecklade länder (per december 2020). Indexet syftar 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](http://www.amundiETF.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI UK IMI SRI PAB

#### 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 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 % 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

### **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<sub>2</sub>) 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 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:

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 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 det överordnade indexet.

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.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade 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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

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?***

För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 högentensiva 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI UK IMI SRI Filterd PAB Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI UK IMI SRI Filterd PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI United Kingdom IMI Index ("överordnat index"), 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 viktat om värdepapper baserat på de möjligheter och risker som är förknippade med

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

klimatomställningen för att uppfylla minimikraven i EU:s förordning om klimatomställning enligt Paris-avtalet (EU PAB).

● ***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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI UK IMI 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:

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 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 det överordnade indexet.

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.

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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i det överordnade indexet

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?**

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

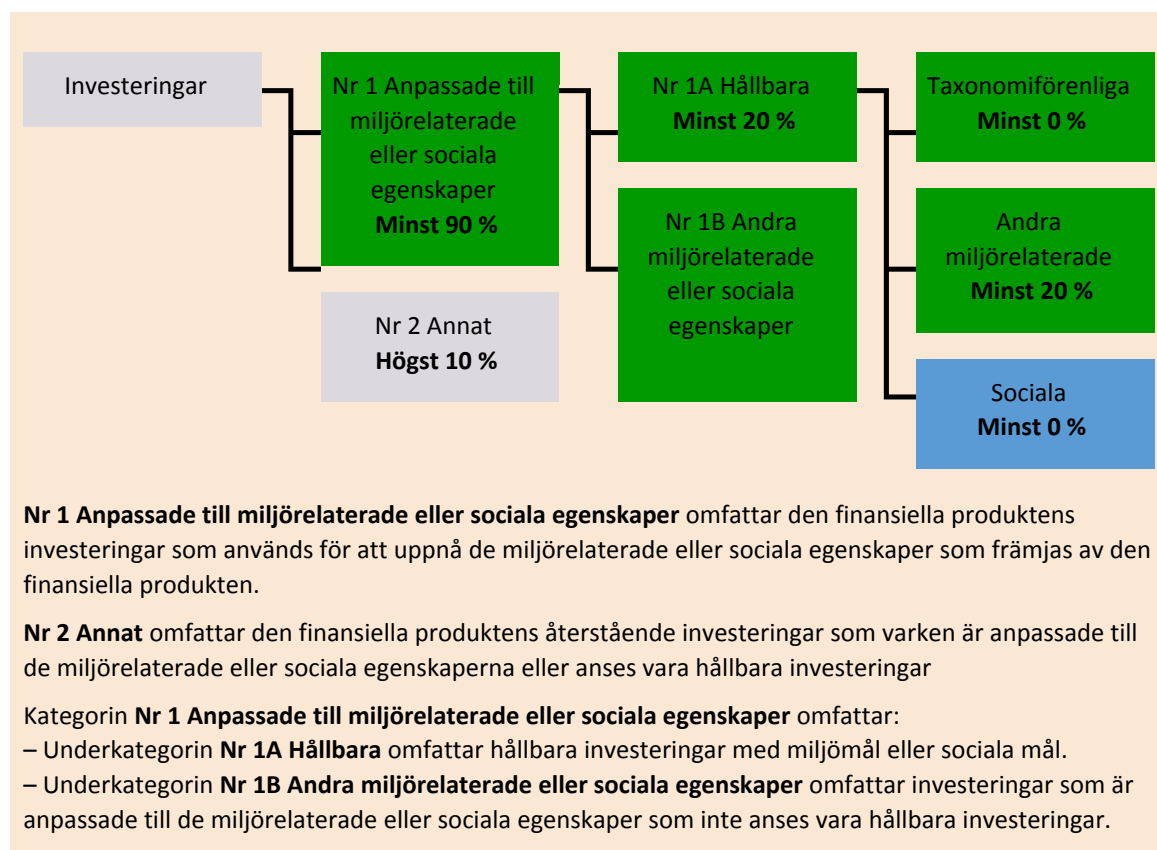
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

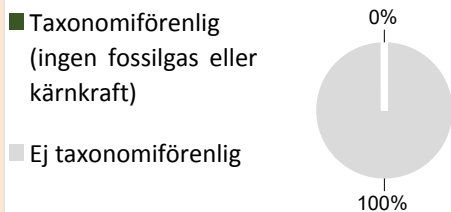
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

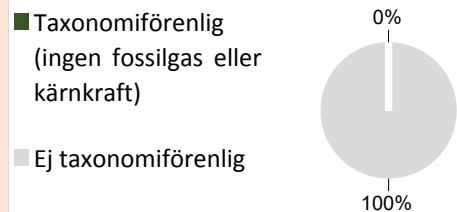
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI UK IMI SRI Filterd PAB Index är ett aktieindex baserat på MSCI United Kingdom IMI Index som är representativt för stora, medelstora och små företag på den brittiska marknaden ("moderindexet"). Indexet ger exponering mot företag som har högsta betyg vad gäller miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) i varje sektor hos moderindexet, och utesluter företag vars produkter har en negativ social eller miljömässig inverkan. Indexet syftar dessutom till att representera resultatet för en strategi som viktat 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](http://www.amundietf.com).

Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI ITALY MIB ESG

Identifieringskod för juridiska personer:

549300RPOWOZJH77LP16

## 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 % 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). 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).

● ***Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?***

Moody's ESG-betyg används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt.

Moody's ESG-lösningar bedömer och betygsätter företagets resultat enligt Equitics®-metoden utifrån 38 kriterier, uppdelat på sex nyckelområden för företagets ansvar för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning. Varje emittent tilldelas ett totalt betyg av 100 (ju högre desto bättre) som är ett viktat och konsoliderat betyg för alla hållbarhetsfaktorer i en viss sektor.

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 60 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 Moody's får inte tas med i indexet.

– Företag som enligt information från Moody's är inblandade i kontroversiella vapen, civila skjutvapen, brytning av termiskt kol, koleddad kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte tas med i indexet.

– De godtagbara företagen rangordnas i fallande ordning efter ESG-betyget enligt Moody's. Om företag har samma betyg kommer företaget med högst fritt omsättningsbart börsvärde att rangordnas högre.

Varje indexkomponent viktas sedan enligt fritt omsättningsbart börsvärde med ett tak på 10 % och så att indexviktad genomsnittlig koldioxidintensitet (WACI) förbättras jämfört med indexets tillämpliga område. Om WACI lämnas oförbättrad jämfört med indexets område, kommer vikten för företaget med den sämsta viktade koldioxidintensiteten (WCI) att minskas (upp till 30 %) tills indexets WACI är under WACI för indexets tillämpliga område.

● ***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 "presterar bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presterar bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presterar 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](http://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 förvaltrade 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. 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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer

- ***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:

som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av korruption och mutor.

Det första testfiltret 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

Bli rentvård 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-taxonomin 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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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](http://www.amundi.lu).

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### 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.

MIB ESG Index är ett aktieindex som representerar de 40 främsta företagen som uppvisar stark praxis för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning bland de 60 mest likvida italienska företagen som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV.

#### ***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 förvaltda börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MIB ESG Index ("indexet") sätts samman utifrån alla företag som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV och tillämpar följande filter:

De 60 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 Moody's får inte tas med i indexet.



– Företag som enligt information från Moody's är inblandade i kontroversiella vapen, civila skjutvapen, brytning av termiskt kol, koldioxid kraftproduktion, tjärsand, olja och tobak får inte tas med i indexet.

– De godtagbara företagen rangordnas i fallande ordning efter ESG-betyget enligt Moody's. Om företag har samma betyg kommer företaget med högst fritt omsättningsbart börsvärde att rangordnas högre.

Varje indexkomponent viktas sedan enligt fritt omsättningsbart börsvärde med ett tak på 10 % och så att indexviktad genomsnittlig koldioxidintensitet (WACI) förbättras jämfört med indexets tillämpliga område. Om WACI lämnas oförbättrad jämfört med indexets område, kommer vikten för företaget med den sämsta viktade koldioxidintensiteten (WCI) att minskas (upp till 30 %) tills indexets WACI är under WACI för indexets tillämpliga område.

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?***

Vi förlitar oss på Amundis ESG-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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-betygs metod. 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 kommer att uppfylla 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.

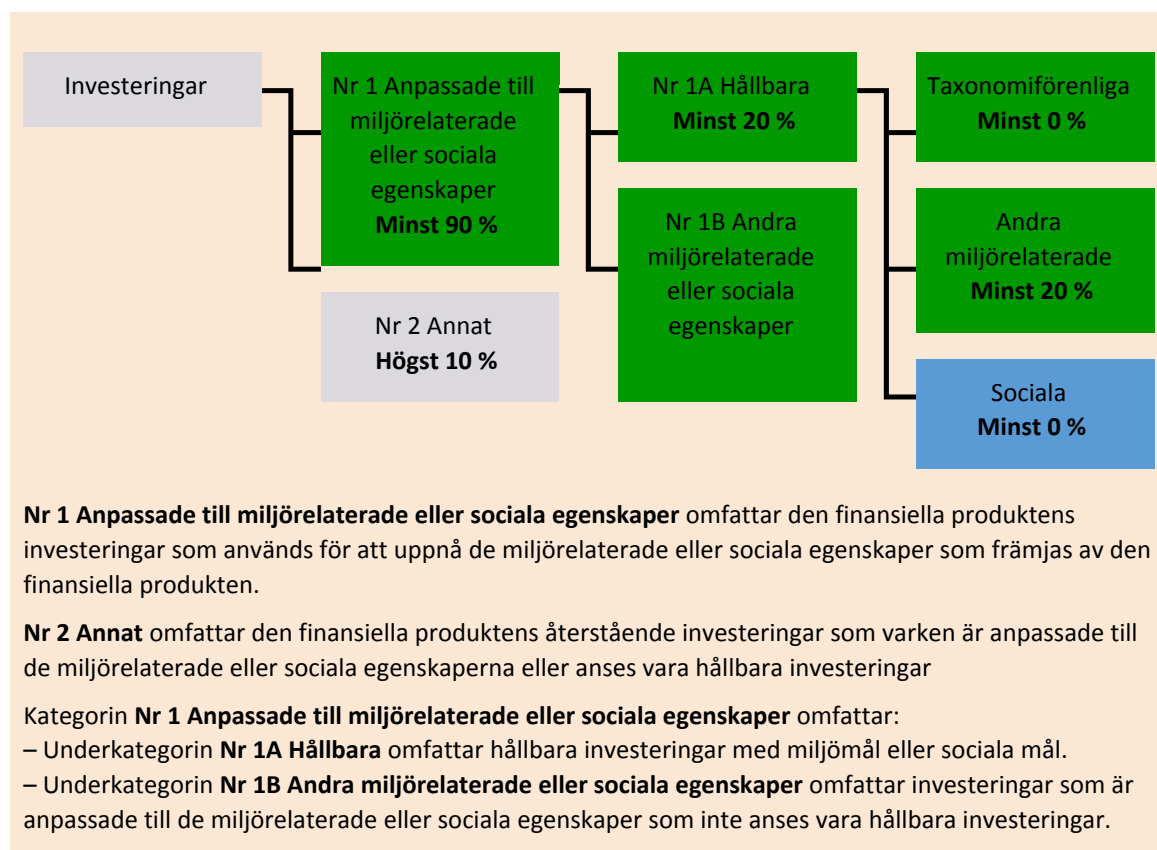
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

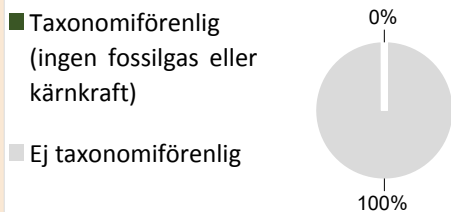
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

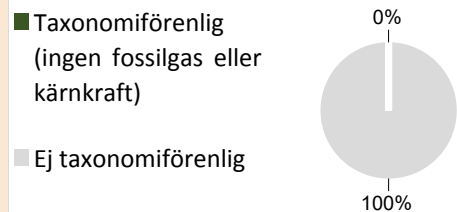
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MIB ESG Index är ett aktieindex som representerar de 40 främsta företagen som uppvisar stark praxis för miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning bland de 60 mest likvida italienska företagen som är noterade på marknaderna Euronext Milan MTA och MIV.

● ***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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI USD FLOATING RATE CORPORATE BOND ESG

#### Identifieringskod för juridiska personer:

549300W6M26WPJCWRV83

## 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 % 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). 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).

● ***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 [bloombergingredients.com](https://www.bloombergingredients.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](https://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 förvaltrade 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. 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](http://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 investeringsbesluts 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 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. investeringsobjektets 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. För att säkerställa att hållbara investeringar inte orsakar betydande skada använder Amundi två filter:

Det första testfiltret 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. investeringsobjektets 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

Bli rentvård 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-taxonominns 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 uteslutningspolicier (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.

För varje indikation på hur obligatoriska indikatorer för huvudsakliga negativa konsekvenser används, se Amundi ESG Regulatory Statement som finns på [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu). 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

 Nej



### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

## 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 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.

### ● **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 förvaltd 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](https://www.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.

### ● **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 kommer att uppfylla 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. 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 kommer att uppfylla 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.

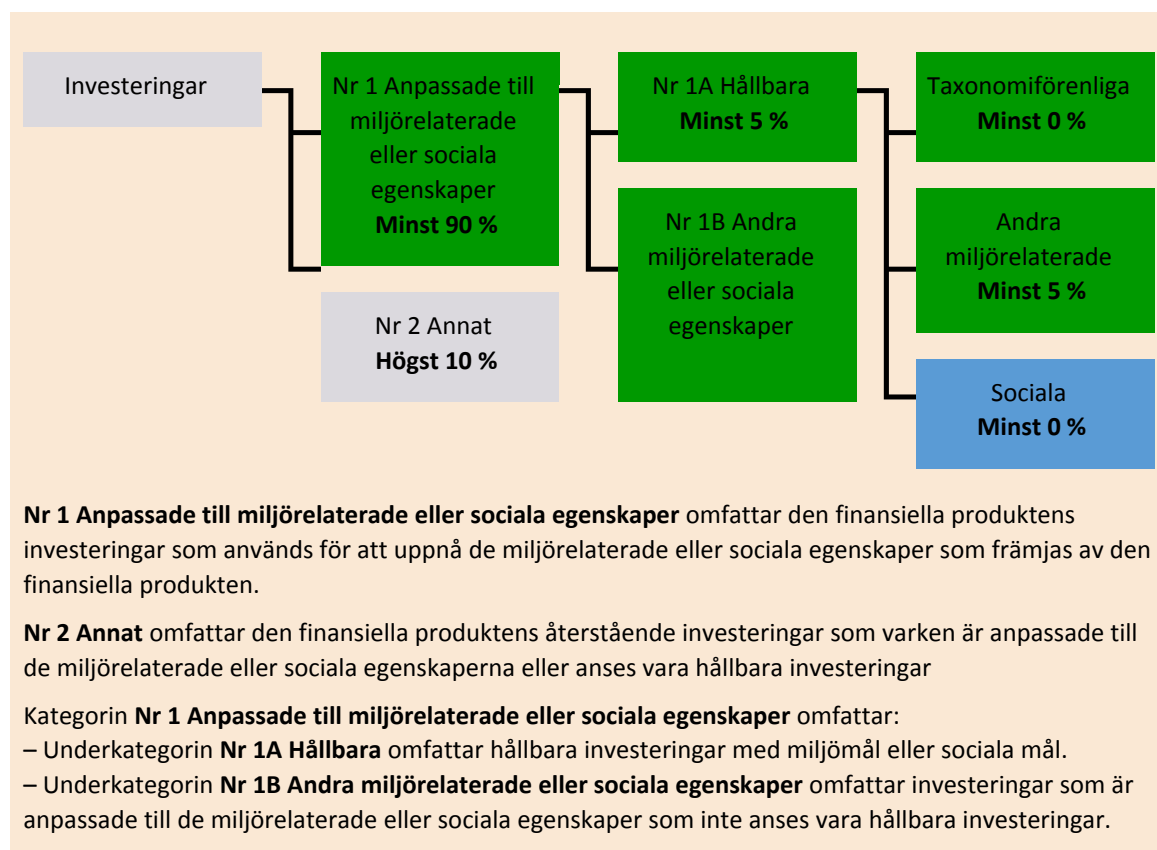
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 5 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

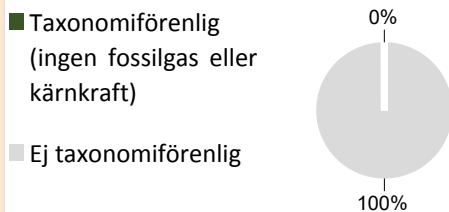
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

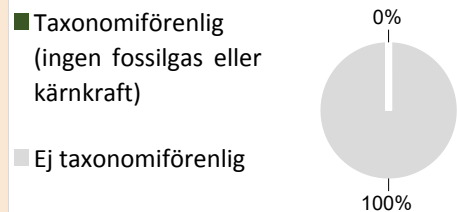
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att förbinda 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI EUR CORPORATE BOND 1-5Y ESG

#### Identifieringskod för juridiska personer:

222100VHBKJHMDJL8J52

## 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 % 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).

### **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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonominns 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. 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.

### 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 förvaltd 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.

● ***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.



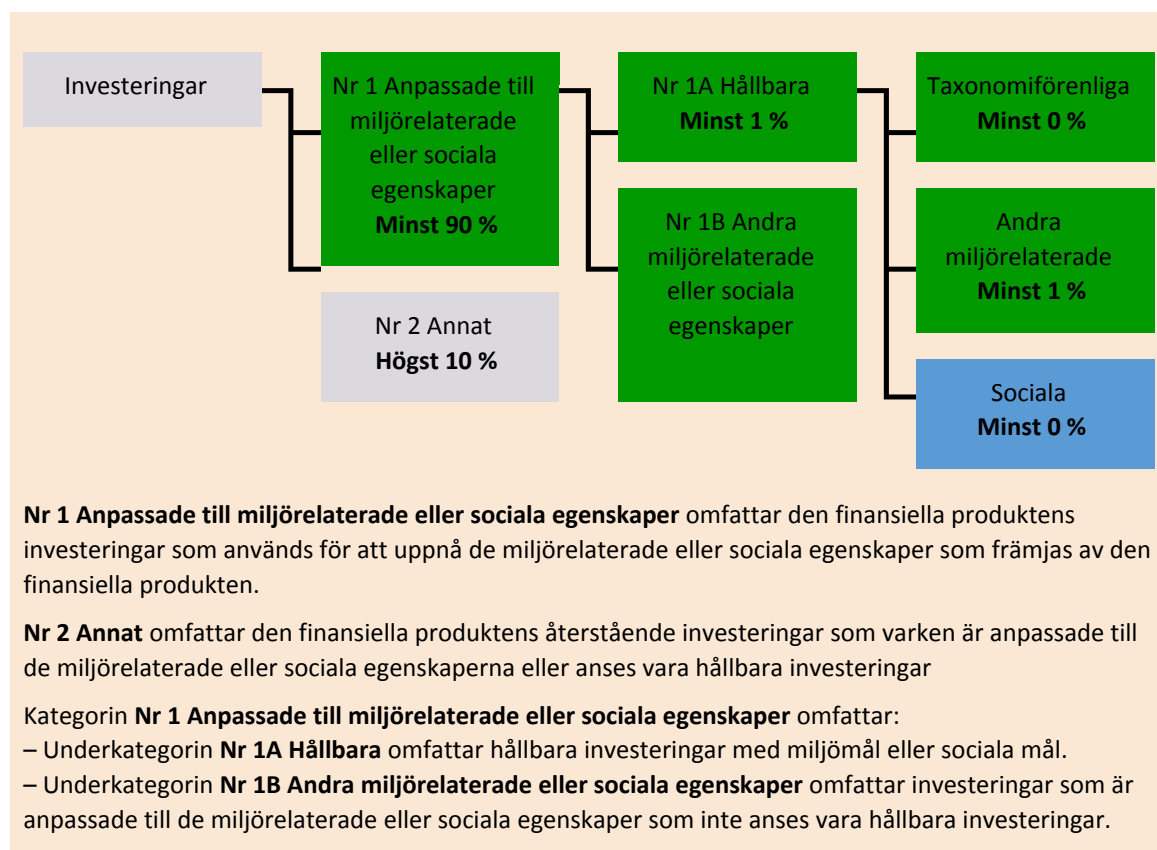
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

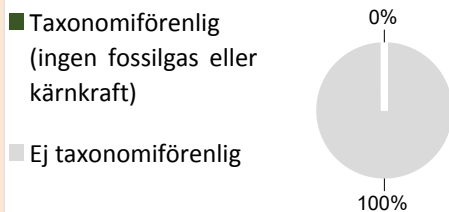
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

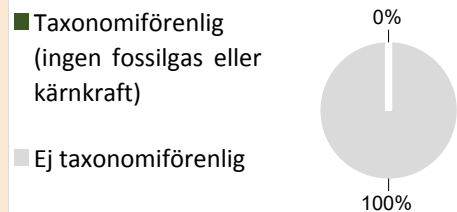
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

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](http://www.amundietf.com).



15/05/2024.

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI MSCI EMU ESG CTB NET ZERO AMBITION

**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 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 % 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 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.

**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<sub>2</sub>) dividerat med företagsvärdet inklusive konanter.

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 Index ("indexet") samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet.

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 borrhning 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i moderindexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

### **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](http://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 investeringsbesluts 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 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-taxonomi 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU Index ("överordnat index"), som representerar stora och medelstora värdepapper från länder i den europeiska ekonomiska och monetära unionen (EMU). Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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).

#### ● 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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index ("indexet") sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet.

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 borrhning 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i moderindexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

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?***

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.

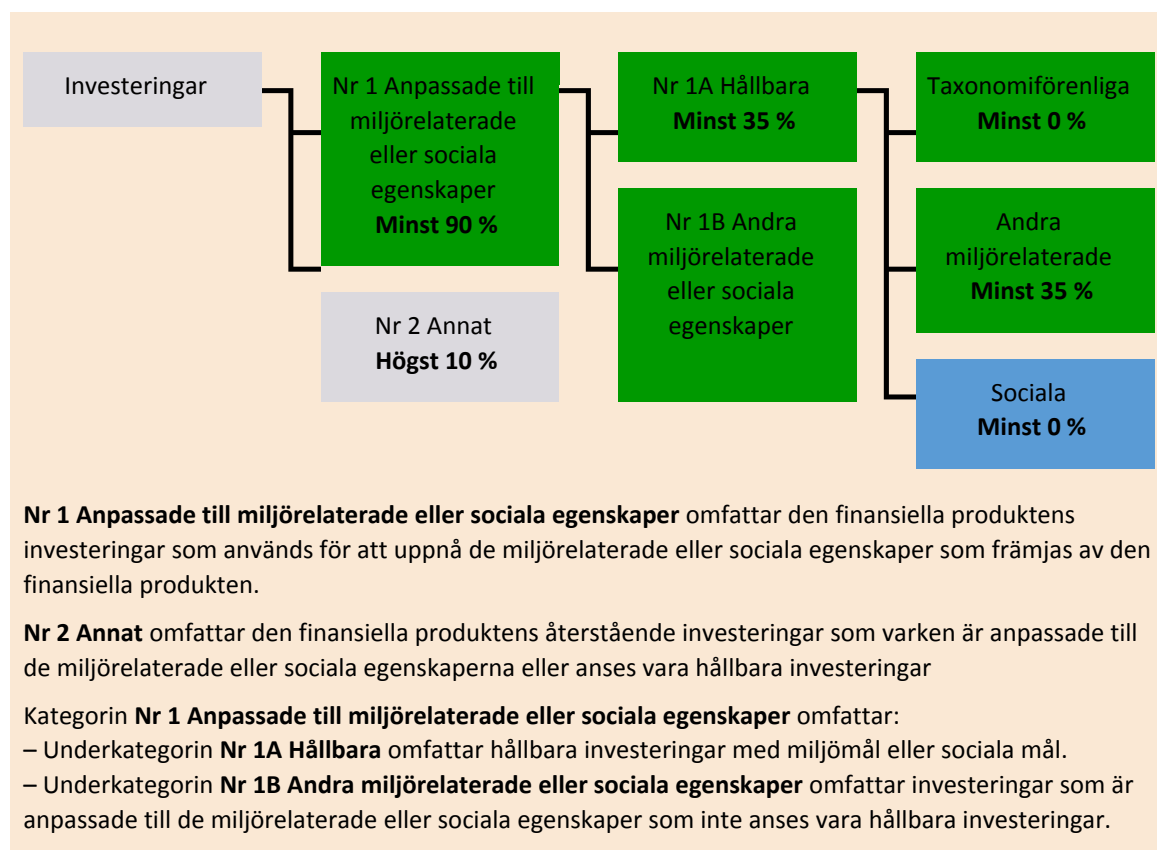
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 35 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

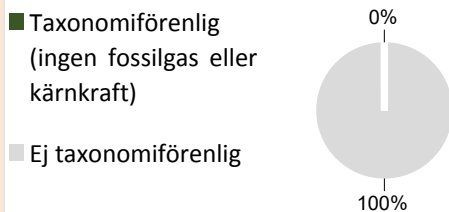
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

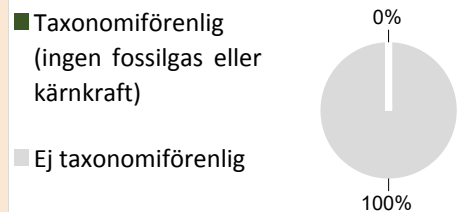
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI EMU ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EMU Index ("överordnat index"), som representerar värdepapper från stora och medelstora bolag på utvecklade marknader i Europa. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI MSCI EMU SMALL CAP ESG CTB NET ZERO AMBITION

Identifieringskod för juridiska personer:

213800EOKXEM989MZ785

## 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 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 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.

### **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<sub>2</sub>) 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 Index ("indexet") samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet.

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 borrhning 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 för hög klimatpåverkan ("High Climate Impact Sector") är lika stor som i moderindexet
3. Inriktning mot en aktiv risknivå (ex ante) på 0,75 %

I de fall där de tre begränsningarna inte är kompatibla kommer MSCI att släppa på begränsningarna och särskilt öka den aktiva risknivån (ex ante) med 0,1 % i taget.

### **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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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 rentvård från eventuella kontroverser beträffande arbetsförhållanden och mänskliga rättigheter

- bli rentvård 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-taxonominns 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI EMU Small Cap ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Index, som representerar värdepapper från stora och medelstora bolag på utvecklade marknader i Europa ("överordnat index"). Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga ESG-betyg. 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).

#### ● 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

MSCI EMU Climate Paris Aligned Filtered 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, elproduktion och vapen baserade 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:

- Lägsta minskning av växthusgasintensiteten (scope 1, 2 och 3) med 50 % jämfört med det överordnade indexet.
- Lägsta genomsnittliga minskning (per år) av växthusgasintensiteten med 10 % i förhållande till växthusgasintensiteten vid basdatumet.
- Aktiv vikt i sektorn med hög klimatpåverkan som är minst lika stor som det överordnade indexets.
- Ökning av den sammanlagda vikten i företag som fastställer mål i förhållande till den sammanlagda vikten av sådana företag i det överordnade indexet.
- Minskning av den viktade genomsnittliga potentiella utsläppsintensiteten i förhållande till det överordnade indexet.
- Ökning av sammanlagt klimat-VaR under 1,5-gradersscenariot och jämfört med det överordnade indexet. MSCI:s mått på klimat-VaR hjälper investerare att bedöma framtida kostnader relaterade till klimatförändringar och förstå vad dessa framtida kostnader kan innebära vid den aktuella värderingen av värdepapper.
- Minskning av viktat genomsnittligt klimat-VaR för extremt väder (aggressivt scenario) i förhållande



till det överordnade indexet.

2. Mål för omställningsmöjligheter:

- a. Ökning av viktat genomsnittligt betyg för omställning till låga koldioxidutsläpp i förhållande till det överordnade indexet.
- b. Förbättring av förhållandet mellan viktade genomsnittliga gröna intäkter/viktade genomsnittliga intäkter baserade på fossila bränslen i förhållande till det överordnade indexet.
- c. Ökning av viktade genomsnittliga gröna intäkter i förhållande till det överordnade indexet.

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.

● ***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.



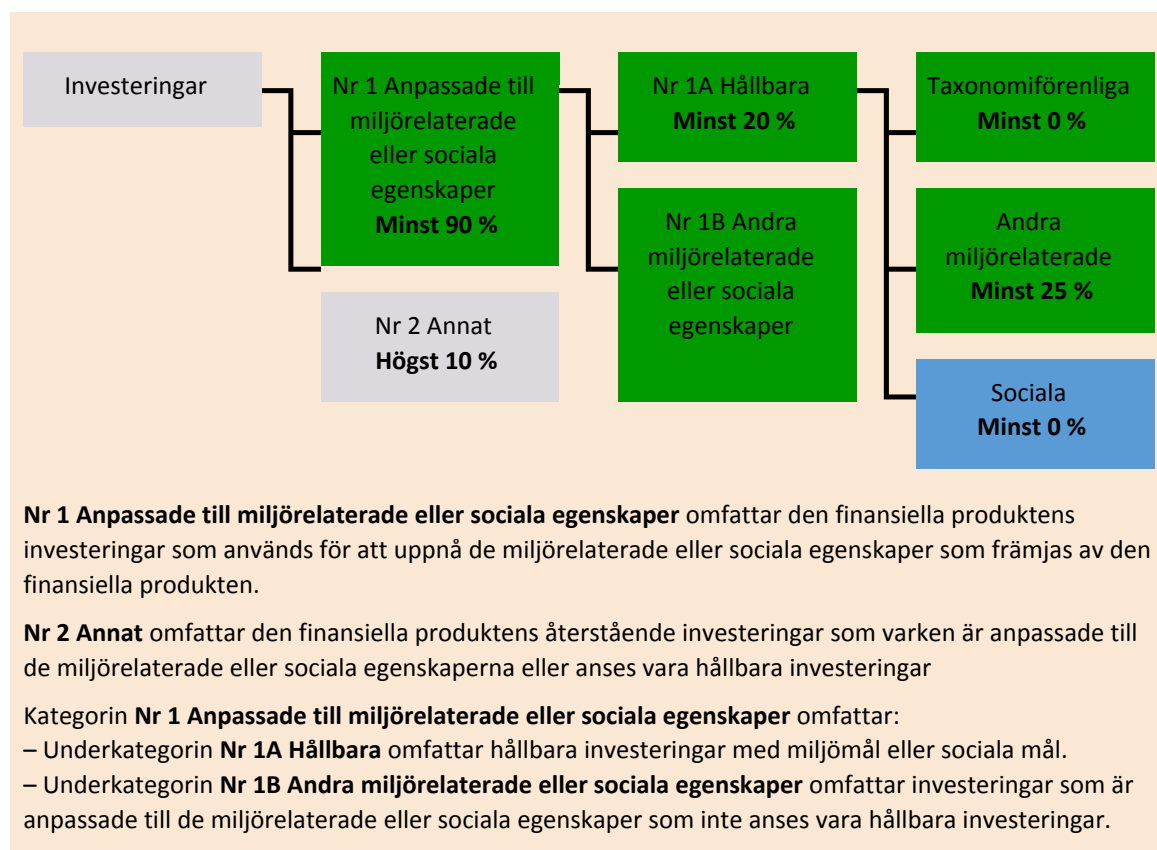
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 25 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

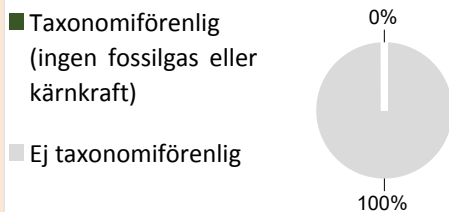
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

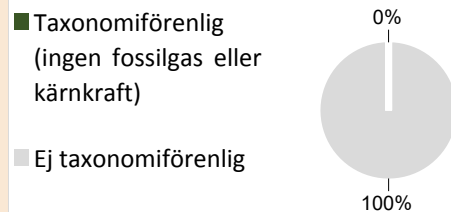
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

MSCI Europe Small Cap ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI Europe Small Cap Index ("överordnat index"), representativt värdepapper från små bolag på utvecklade marknader från länder i den europeiska ekonomiska och monetära unionen (EMU). Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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](http://www.amundietf.com).

Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI USD CORPORATE BOND PAB NET ZERO AMBITION

**Identifieringskod för juridiska personer:**

213800713AA69XKCG155

**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 % 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 lägsta minskning av växthusgasintensiteten i förhållande till det överordnade indexet på 50 %. – En lägsta 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.

**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 Paris Aligned Green Tilted Index ("indexet") att vara representativt för den USD-denominerade marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg och samtidigt uppfylla och överträffa minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Indexet använder en optimeringsmetod som syftar till att minimera den aktiva totala risken med avseende på det överordnade indexet under begränsningar. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och emitterats av företag på utvecklade marknader ("området") väljer indexmetoden obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till: 1) minsta utestående belopp på obligationsnivå; 2) återstående tid till förfall; 3) senioritet för skuld: Seniora och efterställda emissioner ingår, 4) emittenter tillskrivs 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 godtagbarhetskriterierna 1 till 4 leder till ett begränsat investeringsområde ("det godtagbara området"). Det godtagbara området granskas för att utesluta emittenter som: – är involverade i verksamheter såsom alkohol, hasardspel, tobak, termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, elproduktion, kärnvapen, kontroversiella vapen, konventionella vapen, eller civila skjutvapen och aktiviteter som baseras på intäktströsklar som definieras indexmetoden, – involverade i en större ESG-dispyt (baserat på MSCI:s ESG-kontroversbetyg), – är involverade i miljöbaserade kontroverser (exempelvis baserat på MSCI:s miljökontroversbetyg, – har identifierats att ha agerat i strid mot FN:s Global Compact-principer; – har ett "MSCI ESG-betyg" som är lägre än BB. När det godtagbara området har granskats, genomförs en optimeringsprocess för urval och viktning av varje värdepapper i indexet för att minimera total aktiva risken jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Optimeringsprocessen tar bland annat hänsyn till följande begränsningar: – Klimatbegränsningar som, men inte begränsas till: o en minskning av viktade genomsnittliga absoluta växthusgasutsläpp i förhållande till det överordnade indexet vid startdatum. o en lägsta årlig minskning av viktade genomsnittliga absoluta utsläpp av växthusgaser i förhållande till det överordnade indexet. o en minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning i förhållande till det överordnade indexet vid startdatum. o en minimal årlig minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning i förhållande till det överordnade indexet. – Begränsningar för gröna obligationer såsom en minimal ökning av viktning av gröna obligationer i förhållande till deras vikt i det överordnade indexet. – Begränsningar av investeringsbarhet som syftar till att upprätthålla en liknande riskprofil med avseende på det överordnade indexet (såsom obligationsviktning, avkastning och varaktighet, 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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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. – 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-taxonoms 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index ("indexet") är konstruerat utifrån Bloomberg US Corporate Index ("överordnat index") och avser att vara representativt för den USD-denominerade marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg och samtidigt uppfylla och överträffa minimikraven i förordningen om 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 10 % 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.

#### ● 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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index ("indexet") avser att representera den USD-denominerade marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg och samtidigt uppfylla och överträffa minimikraven i förordningen om EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Indexet använder en optimeringsmetod som syftar till att minimera den aktiva totala risken med avseende på det överordnade indexet under begränsningar.

Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och emitterats av företag på utvecklade marknader ("området") väljer indexmetoden obligationer med kriterier såsom, men inte begränsat till:

- 1) minsta utestående belopp på obligationsnivå
- 2) återstående löptid
- 3) senioritet för skuld: Både högre och lägre prioriterade emissioner ingår.
- 4) 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 godtagbarhetskriterierna 1 till 4 leder till ett begränsat investeringsområde ("det godtagbara området").

Det godtagbara området granskas för att utesluta emittenter som:

- är involverade i verksamheter såsom alkohol, hasardspel, tobak, termiskt kol, olja och gas, okonventionell olja och gas, elproduktion, kärnvapen, kontroversiella vapen, konventionella vapen, eller civila skjutvapen, baserat på tröskelvärden för intäkter enligt definitionen i indexets metod.
- är involverade i större ESG-kontroverser (baserat på MSCI:s ESG-kontroversbetyg),
- är involverade i miljökontroverser (baserat på MSCI:s ESG-kontroversbetyg),
- har identifierats att ha agerat i strid mot FN:s Global Compact-principer,
- har ett MSCI ESG-betyg som är lägre än BB.

När det godtagbara området har granskats, genomförs en optimeringsprocess för urval och viktning av varje värdepapper i indexet för att minimera den aktiva totala risken jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimistandarderna för EU-referensvärden för anpassning till Parisavtalet. Optimeringsprocessen tar bland annat hänsyn till följande begränsningar:

- Klimatbegränsningar såsom, men inte begränsat till:
  - o En minskning av de viktade genomsnittliga absoluta växthusgasutsläppen i förhållande till det överordnade indexet vid startdatum.
  - o En minskning av de viktade genomsnittliga absoluta växthusgasutsläppen i förhållande till det överordnade indexet vid startdatum.
  - o En minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning i förhållande till det överordnade indexet vid startdatum.
  - o En minimal årlig minskning av viktad genomsnittlig koldioxidintensitet/försäljning i förhållande till det överordnade indexet.

- Begränsningar för gröna obligationer såsom en minimal ökning av viktning av gröna obligationer i förhållande till deras vikt i det överordnade indexet.

- Begränsningar av investeringsbarhet som syftar till att upprätthålla en liknande riskprofil med avseende på det överordnade indexet (såsom obligationsviktning, avkastning och varaktighet, sektor, land med riskbegränsningar) enligt definitionen i indexmetoden.

Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?***

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.

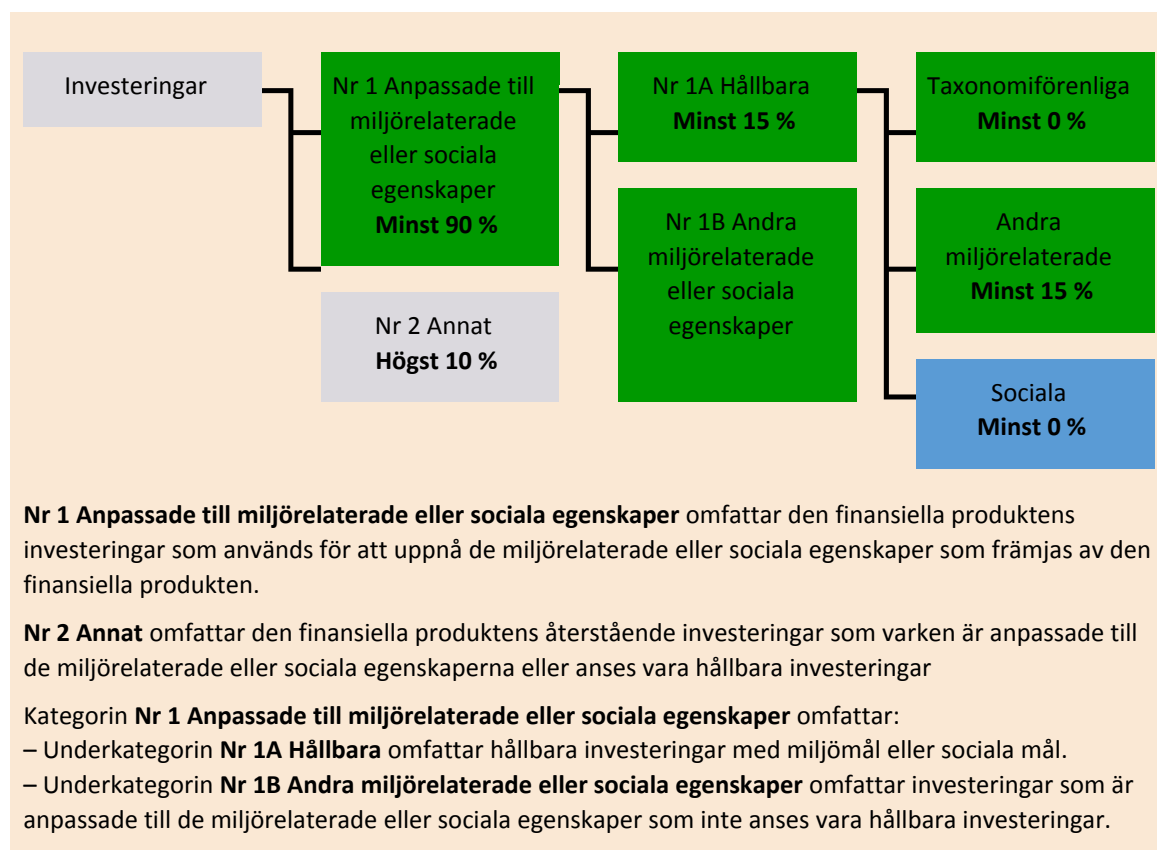
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

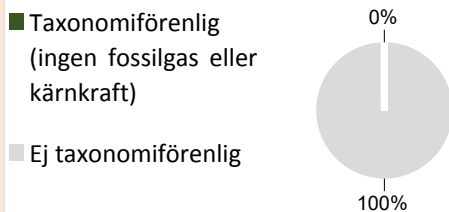
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

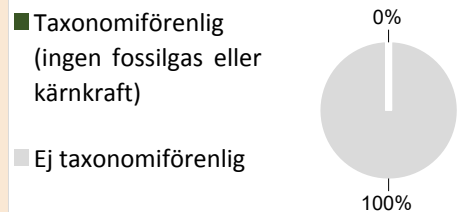
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

Bloomberg MSCI USD Corporate Paris Aligned Green Tilted Index ("indexet") är konstruerat utifrån Bloomberg US Corporate Index ("överordnat index") och avser att vara representativt för den USD-denominerade marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg och samtidigt uppfylla och överträffa minimikraven i förordningen om 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 10 % 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](http://www.amundietf.com).

### **Ansvarsfriskrivning**

15/05/2024.

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI USD HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

**Identifieringskod för juridiska personer:**

213800AHCNYOPPST5889

**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 % 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).

**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. Mer detaljerad information om MSCI:s ESG-betyg finns på följande länk: <https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf> Mer information om MSCI:s 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 Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index (indexet) ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i USD från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i USD och emitteras av företag på utvecklade marknader ("området") 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 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 (i) till (iv) 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 "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](http://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 investeringsbesluts 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 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. – 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. 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 ("överordnat index") 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.

### ● **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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI US Corporate High Yield SRI Sustainable Index (indexet) är ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i USD från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i USD och emitteras av företag på utvecklade marknader ("området") 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 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 (i) till (iv) 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 "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 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?

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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

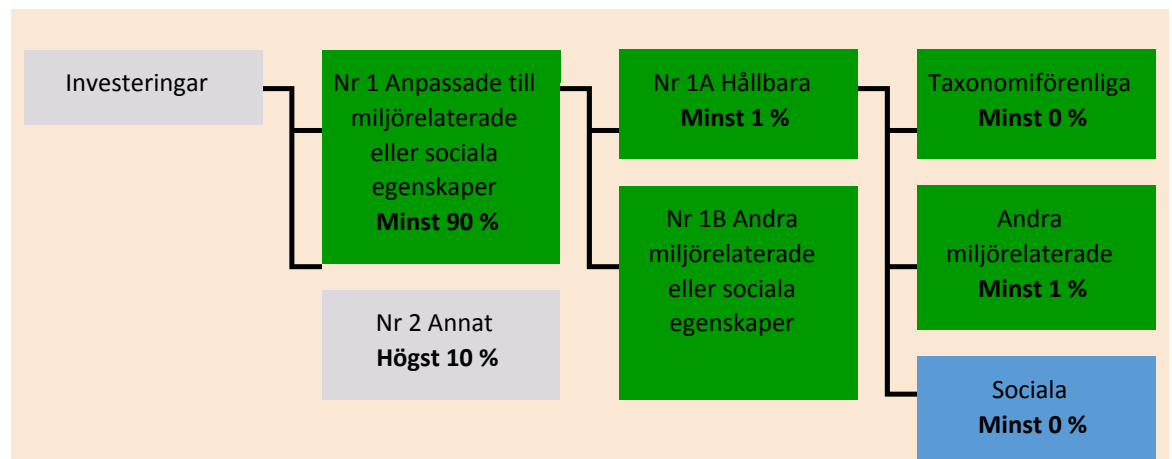
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar den finansiella produkts investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.

**Nr 2 Annat** omfattar den finansiella produkts 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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

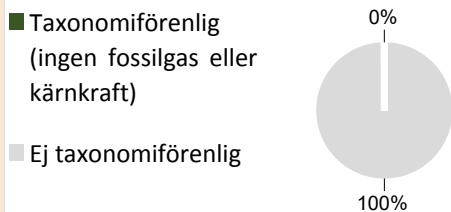
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

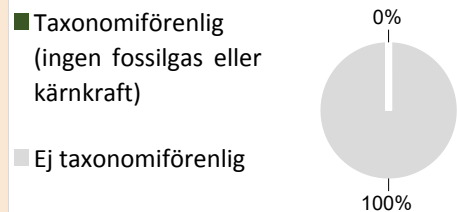
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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 ("överordnat index") 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](http://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI EUR HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

#### Identifieringskod för juridiska personer:

213800ARODHGWDP8MQ71

## 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 % 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).

### **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. Mer detaljerad information om MSCI:s ESG-betyg finns på följande länk: <https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>. Mer information om MSCI:s 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 Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index (indexet) ett obligationsindex som beräknas, underhålls och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i euro från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i euro och emitteras av företag på utvecklade marknader ("området") 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 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 (i) till (iv) 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 "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](http://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 investeringsbesluts 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 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 högentensiva sektorer). – 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. 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 fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg.

### ● **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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken. Bloomberg MSCI Euro Corporate High Yield SRI Sustainable Index (indexet) är ett obligationsindex som beräknas, förvaltas och publiceras av Bloomberg Indices. Det erbjuder exponering mot marknaden för företagsobligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i euro från emittenter som uppfyller ESG-kraven enligt definitionen nedan. Inom området med obligationer med höga kreditbetyg som är denominerade i euro och emitteras av företag på utvecklade marknader ("området") 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 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 (i) till (iv) 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 "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 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?

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 uteslagna från vårt investeringsområde.



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

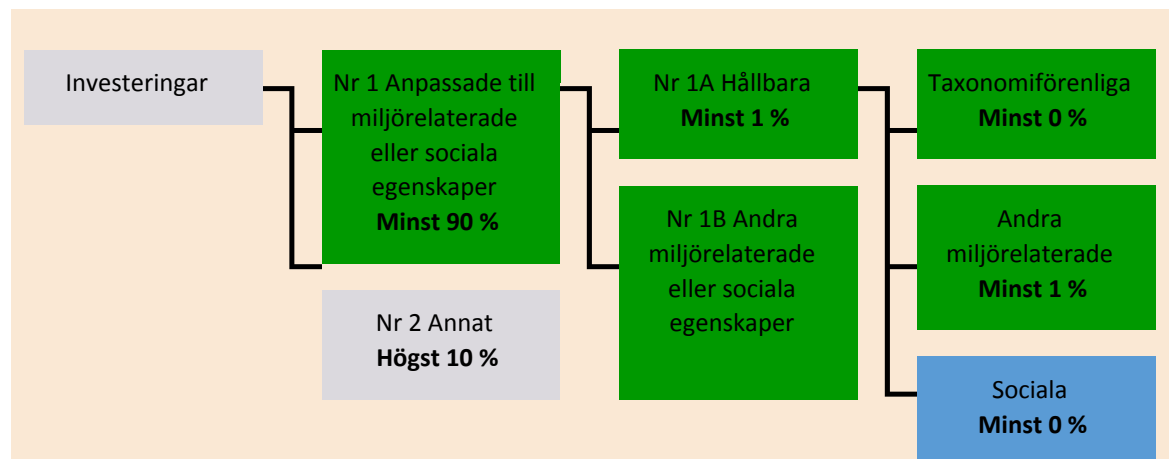
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar den finansiella produkts investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.

**Nr 2 Annat** omfattar den finansiella produkts 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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

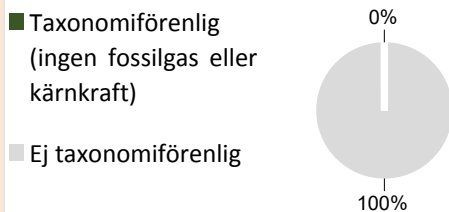
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

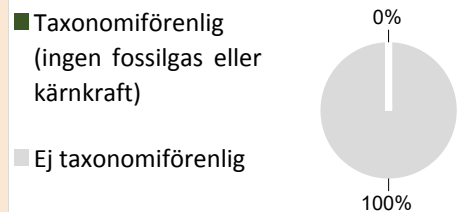
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?

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 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](http://www.amundietf.com).



Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI USD CORPORATE BOND 1–5Y ESG

**Identifieringskod för juridiska personer:**

x

## 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 % 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).

**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 US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI Index ("indexet") följande filter:

1. De värdepapper som ingår i indexet måste ha ett MSCI ESG-betyg på BBB eller högre.
2. Företag som enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval\* ägnar sig åt affärsområden/verksamheter\* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, kärnvapen, civila skjutvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, okonventionell olja och gas, generering av termiskt kol och reserver av fossila bränslen utesluts.
3. Emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg (vilket motsvarar noll), 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-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.

\*Se indexmetoden som finns på [bloombergindices.com](https://www.bloomberg.com/indices) för mer information om affärsområden/verksamheter och urval

### **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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

#### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg MSCI US Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

Bloomberg MSCI US Corporate 1–5 Year ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som är representativt för företagsobligationer med fast ränta och höga kreditbetyg som är denominerade i US-dollar och som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index ("överordnat index"), med en återstående löptid på mellan ett år och fem år i slutet av varje månad och tillämpar ytterligare löptids- och ESG-kriterier för värdepappersurval.

#### 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Bloomberg MSCI US Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI 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 enligt Bloomberg MSCI SRI:s standardurval\* ägnar sig åt affärsområden/verksamheter\* som alkohol, tobak, hasardspel, vuxenunderhållning, genetiskt modifierade organismer (GMO), kärnkraft, kärnvapen, civila skjutvapen, kontroversiella vapen, termiskt kol, okonventionell olja och gas, generering av termiskt kol och reserver av fossila bränslen utesluts.

3. Emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontroversbetyg (vilket motsvarar noll), 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-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.

\*Se indexmetoden som finns på [bloombergingindices.com](https://www.bloombergingindices.com) för mer information om affärsområden/verksamheter och urval

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?***

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.



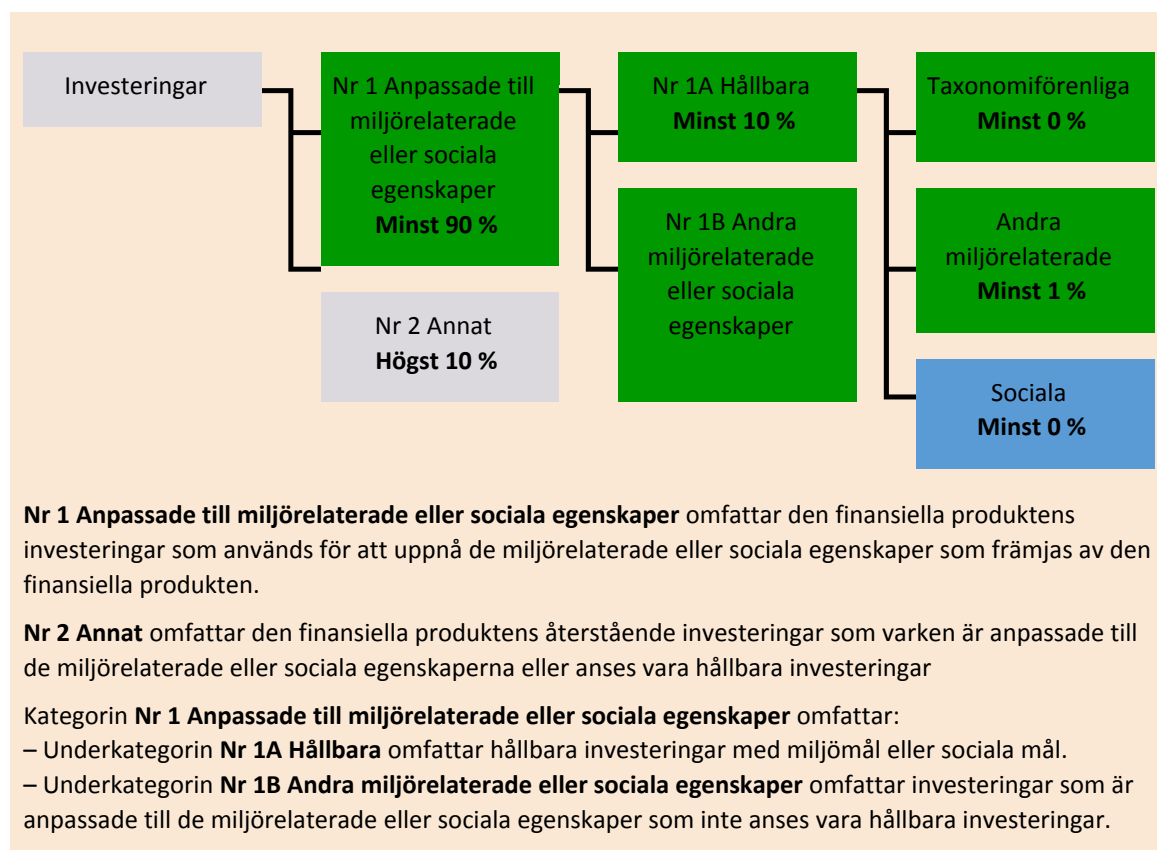
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 (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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 10 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

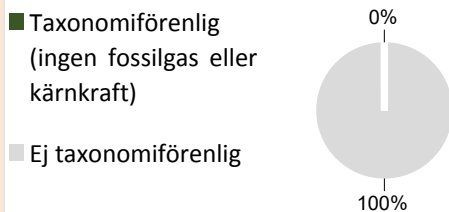
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?*

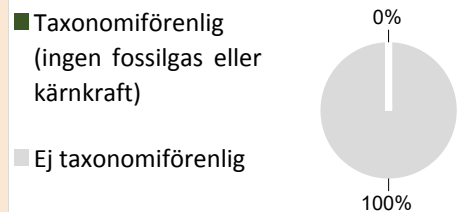
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

*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.*

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

Bloomberg MSCI US Corporate 1-5 Year ESG Sustainability SRI Index är ett obligationsindex som motsvarar företagsvärdepapper med fast ränta och höga kreditbetyg som följer reglerna för Bloomberg US Aggregate Corporate Index (överordnat index) och använder sektor- 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](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI CHINA TECH ESG SCREENED

#### 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 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 % 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).

### **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 US-dollar eller har ett fritt omsättningsbart börsvärde på mindre än 200 miljoner US-dollar 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.

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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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 engagemangsgåtgärderna 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI China Tech IMI All Share Stock Connect ESG Filtered Index (indexet) och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. 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 och utesluter samtidigt företag som är involverade i vissa kontroversiella affärsverksamheter eller har relativt låga MSCI ESG-kontroversbetyg eller MSCI ESG-betyg.

### 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 förvaltda 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 US-dollar eller har ett fritt omsättningsbart börsvärde på mindre än 200 miljoner US-dollar 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.

● ***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.



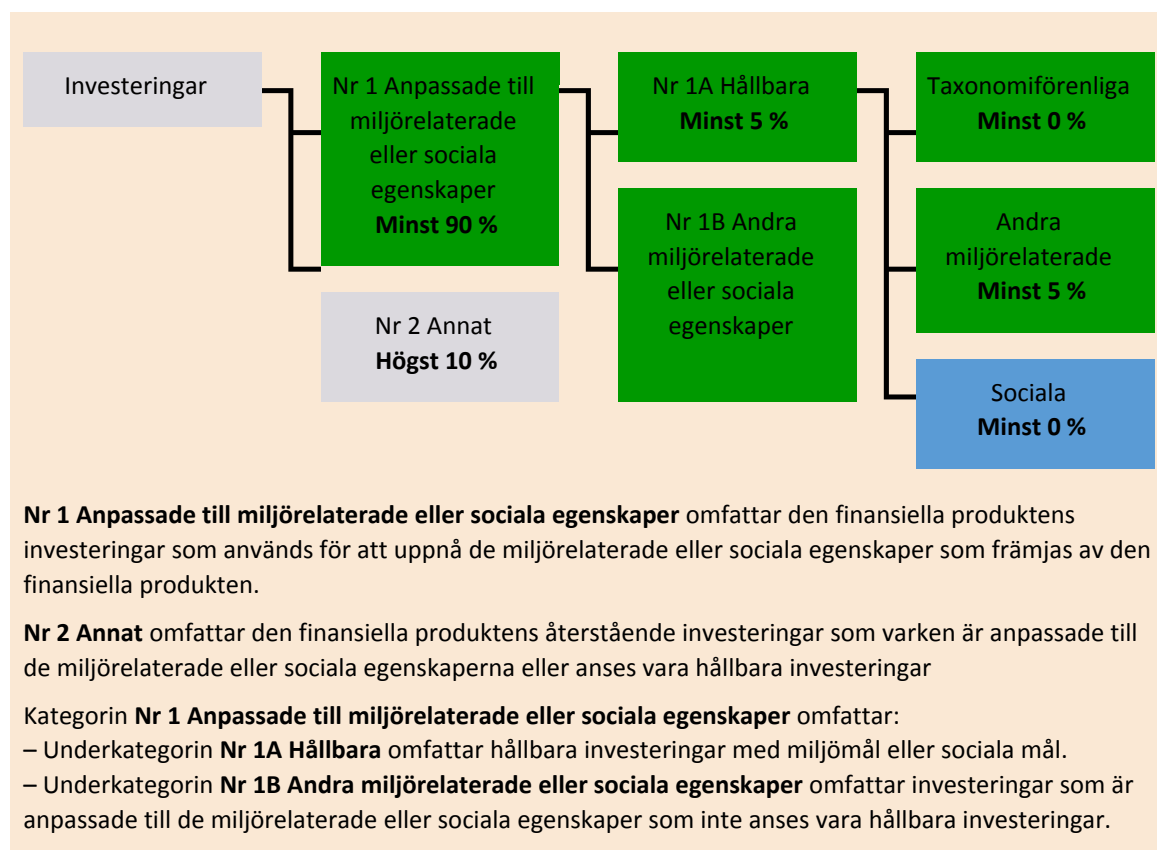
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 5 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

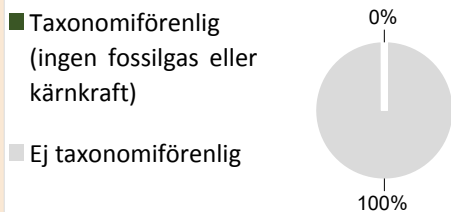
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

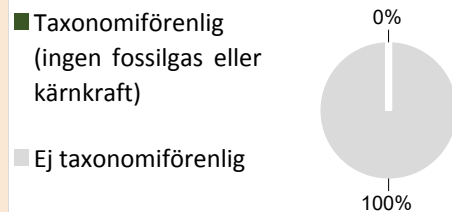
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att förbinda 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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 och utesluter samtidigt 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.amundiethf.com](http://www.amundiethf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI GLOBAL BIOENERGY ESG SCREENED

#### Identifieringskod för juridiska personer:

549300ZVYCLESNKBFX60

## 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 % 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.

### ☒ 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=EAIaIQobChMIv6qz6f5-wIVRbLVCh2X6wdGEAAAYASAAEgLu9vD\\_BwE](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=EAIaIQobChMIv6qz6f5-wIVRbLVCh2X6wdGEAAAYASAAEgLu9vD_BwE)  
För att ett värdepapper ska väljas till Bloomberg BioEnergy ESG 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 US-dollar
- ha ett lägsta 90-dagars genomsnittligt dagligt handelsvärde på 2 miljoner US-dollar.

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.

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](http://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 investeringsbesluts 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 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. investeringsobjektets 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Att följa resultatet för Bloomberg BioEnergy ESG Index ("indexet") och att minimera den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

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.

### 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 förvaltnad börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

För att ett värdepapper ska väljas till Bloomberg BioEnergy ESG 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 US-dollar
- ha ett lägsta 90-dagars genomsnittligt dagligt handelsvärde på 2 miljoner US-dollar.

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.

### 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 kommer att uppfylla 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.

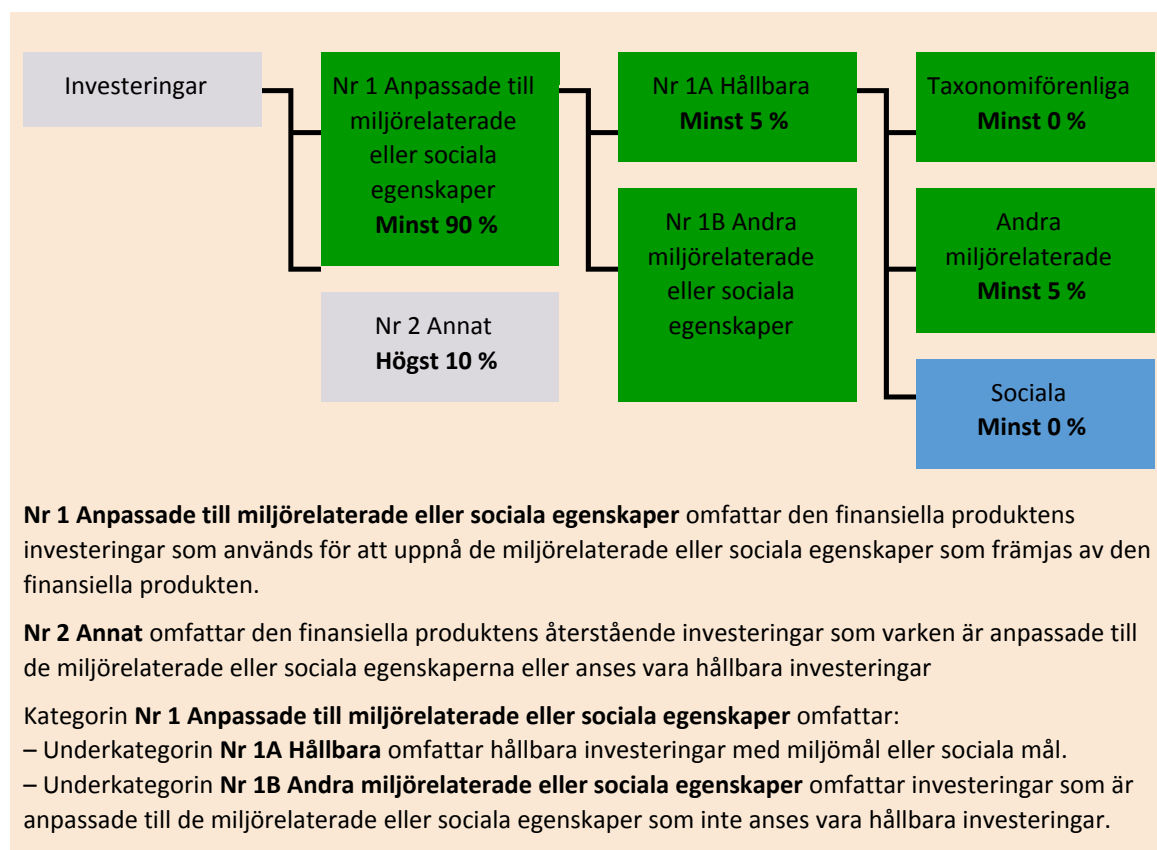
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 5 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

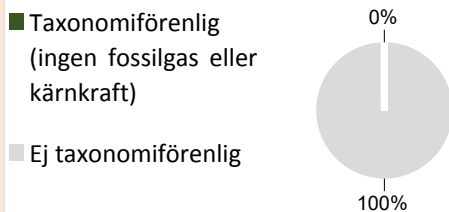
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

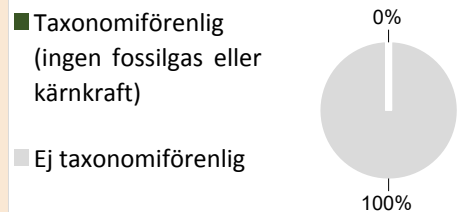
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 med ett miljömål som anges i denna bilaga, utan att förbinda 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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](http://www.amundietf.com).

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI MSCI ROBOTICS & AI ESG SCREENED

#### Identifieringskod för juridiska personer:

54930038GH5HM293HY35

## 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 10 % 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).

### **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 definitionen av MSCI) över 25 % utgör det "valda investeringsområdet".
- d) Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sector 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 definitionen av MSCI).
- 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 definitionen av MSCI) 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. Metoden för MSCI 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 Robotics & AI Index.



Mer information om delfondens allmänna och specifika mål för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) finns i delfondens öppenhetsskod 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.

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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljörelaterade, sociala och personalrelaterade frågor, respekt för mänskliga rättigheter samt bekämpning av

● ***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 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-taxonomin måls, 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](http://www.amundi.lu)

☐ Nej



## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI ACWI IMI Robotics & AI ESG Filtered Net Total Return Index (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.

● **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 förvaltnad 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.

**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

- 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 definitionen av MSCI) över 25 % utgör det "valda investeringsområdet".
- d) Ytterligare filter för likviditet/storlek/land/sector 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 definitionen av MSCI).
- 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 definitionen av MSCI) 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. Metoden för MSCI 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 Robotics & AI Index.

Mer information om delfondens allmänna och specifika mål för miljö, sociala frågor och bolagsstyrning (ESG) finns i delfondens öppenhetsskod 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.

### ● **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 uteslagna från vårt investeringsområde.



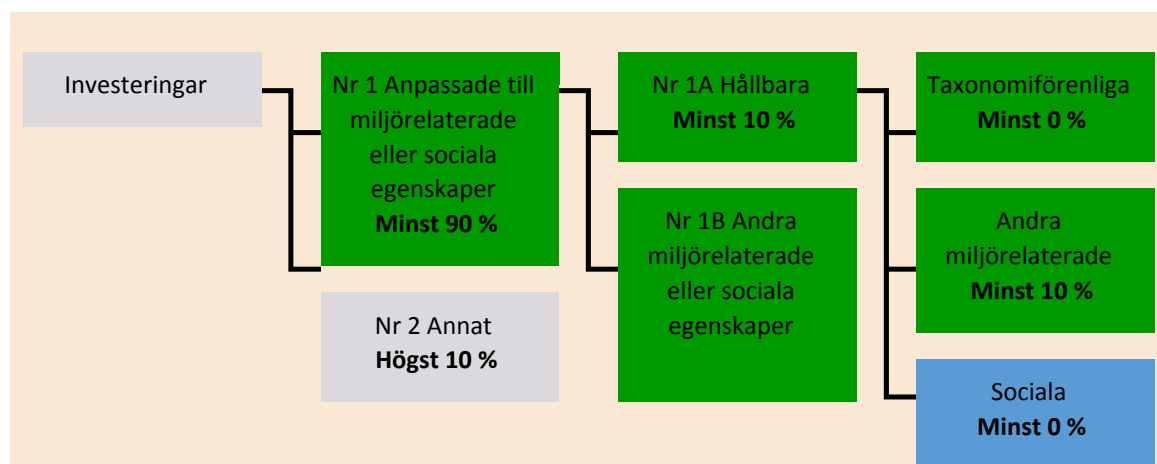
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 (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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 10 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

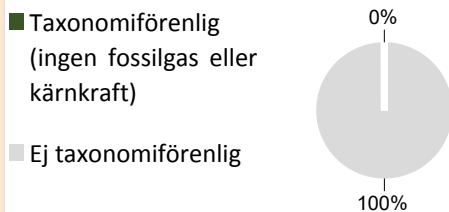
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

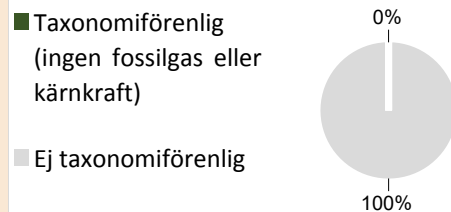
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" ingår kontanter och instrument för likviditets- och portföljrisshantering. 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?***

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](https://www.msci.com)



**Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**

Mer information om delfonden finns på [www.amundietf.com](https://www.amundietf.com).

## Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.



#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

#### Produktnamn:

AMUNDI PEA MSCI USA ESG LEADERS

#### Identifieringskod för juridiska personer:

549300XNMQWJFP5AXO77

## 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 % 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).

### **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 Leaders Select 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 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 det överordnade 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](http://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 förvaldade 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 investeringsbesluts 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 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-taxonomin 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 uteslutningspolicier (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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalsättning och efterlevnad av skatteregler.

### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI USA ESG LEADERS SELECT 5% Issuer Capped Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat.

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index 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.

#### ● 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 förvaltd börshandlad fond. Dess investeringsstrategi är att replikera indexet och samtidigt minimera den relaterade aktiva risken.

Det tillämpliga investeringsområdet för MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index ("indexet") omfattar alla värdepapper i det överordnade indexet.

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 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 det överordnade indexet.

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?***

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.

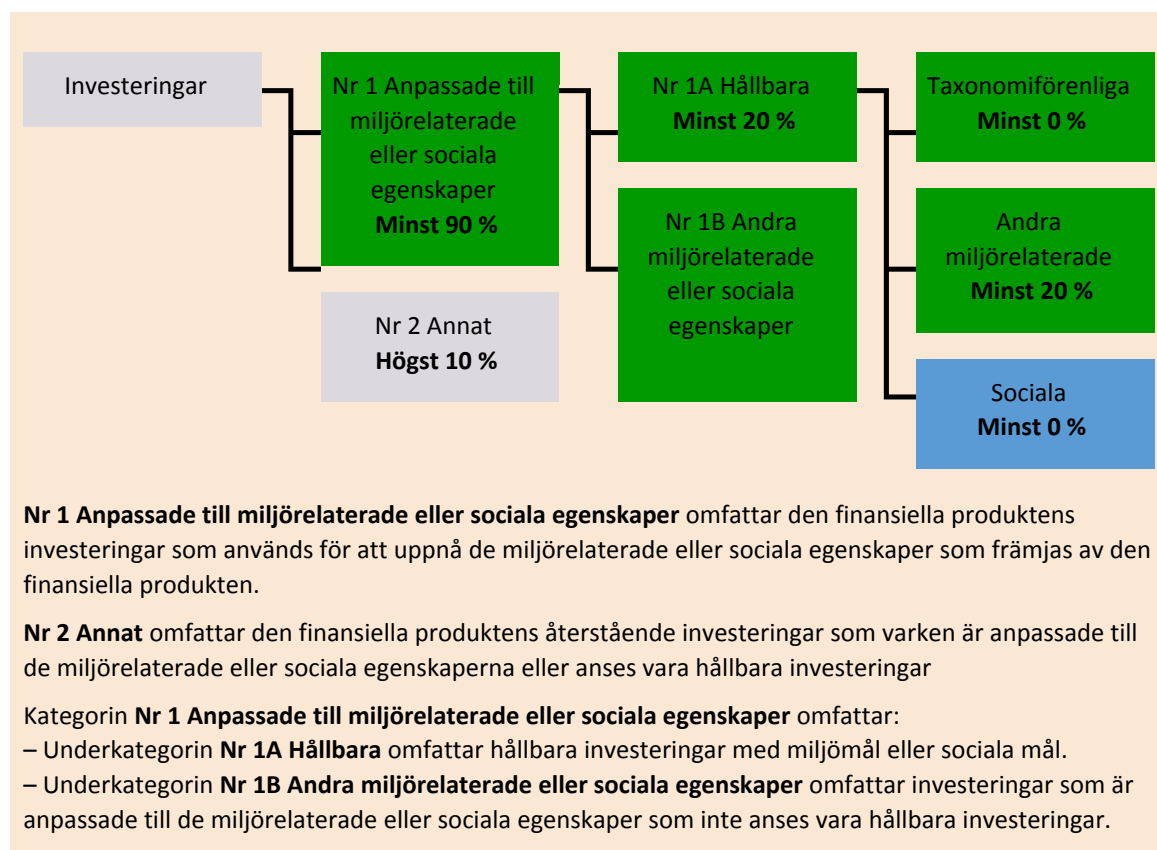
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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).

Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 20 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

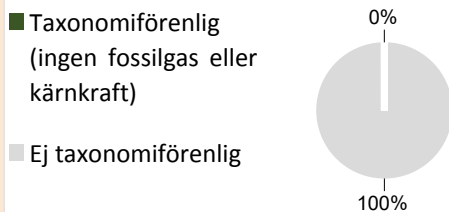
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

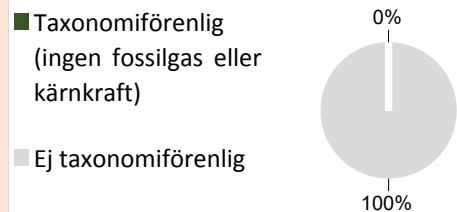
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

MSCI USA ESG Leaders Select 5% Issuer Capped Index 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.

**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](http://www.amundietf.com).

#### 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.

Produktnamn:

AMUNDI GLOBAL HIGH YIELD CORPORATE BOND ESG

Identifieringskod för juridiska personer:

## 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

☐ 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 mål har den en minimiandel på \_\_\_ % 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**



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

### 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).

### ● 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 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 MSCI ESG-betyg finns på följande länk:

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

f. 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.

Mer exakt 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 Bloomberg 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 "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?***

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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts 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-taxonomin 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 den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), integration av ESG-betyg, 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.
  - 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

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable Index ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. 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 ("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 fördefinierade kriterier för företagsengagemang och emittenter med ett "rött" MSCI ESG-kontrovertsbetyg.

### ● **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 förvaltdad 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.

Mer exakt 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 Bloomberg 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-kontrovertsbetyg), – 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 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.

● ***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 kommer att uppfylla 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.

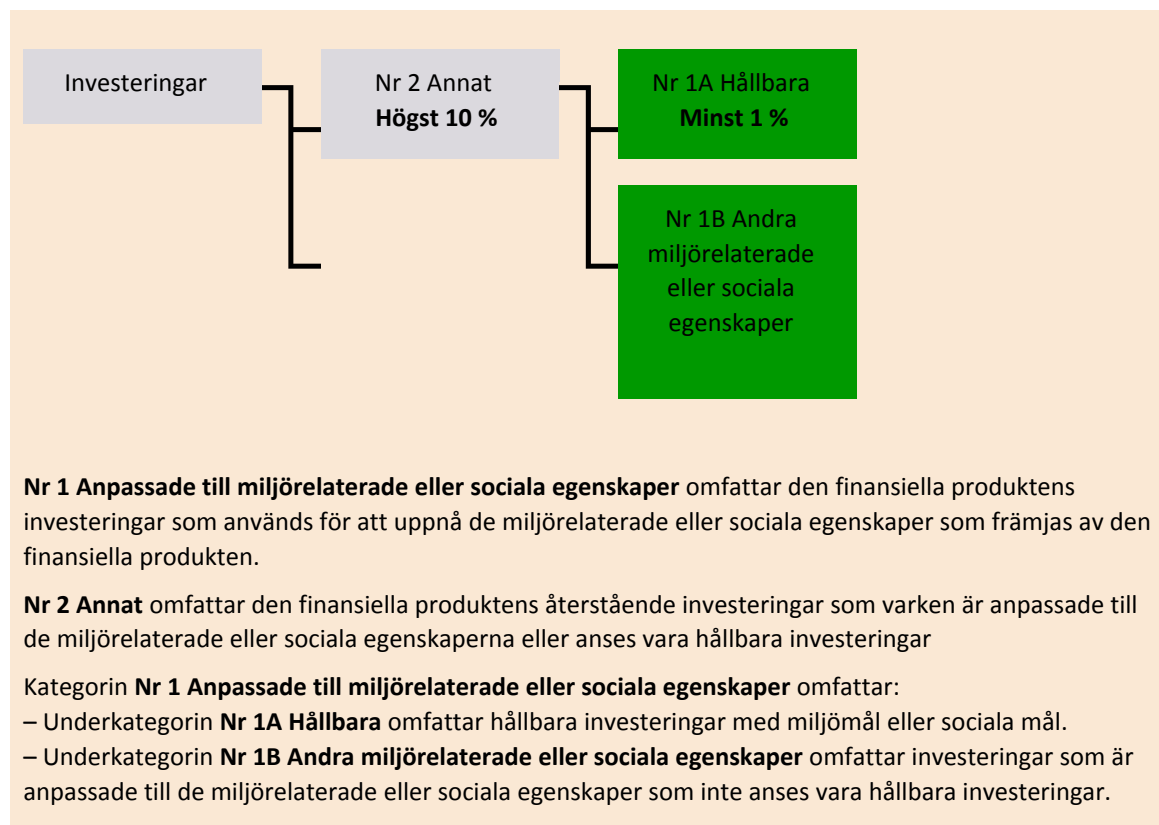
Amundis förvaltningspolicy (engagemang och röstning) relaterad till styrning kompletterar denna metod.



**Tillgångsallokering**  
beskriver andelen  
investeringar i specifika  
tillgångar.

## Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Minst 90 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 1 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.



### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

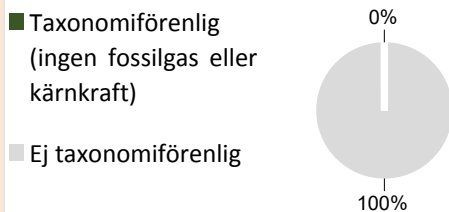
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● *Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?*

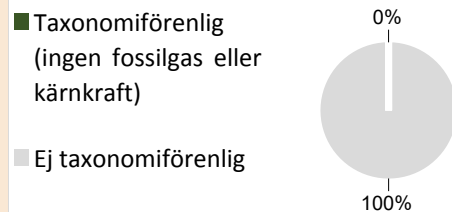
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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, Bloomberg MSCI Global Corporate High Yield SRI Sustainable 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

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 ("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 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](http://www.Bloomberg.com)



### **Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**

Mer information om delfonden finns på [www.amundietf.com](http://www.amundietf.com).

### **Ansvarsfriskrivning**

15/05/2024.

**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**

Gäller från den 19.04.2024

**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.



**Hållbarhetsindikatorer**

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

**Produktnamn:**

AMUNDI MSCI SMART CITIES ESG SCREENED

**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 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 % 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).

**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 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. Mer information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: <https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>. Mer 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) ("överordnat index"). Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som: – smart anslutning (IoT) – smart infrastruktur – smarta byggnader – smarta hem – smart säkerhet – smart mobilteknik – smart vatten- och avfallshantering – 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) ("överordnat index"), 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 definitionen från MSCI) 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-principer och – företag som saknar ESG-betyg (enligt MSCI). f) Ett filtrerat investeringsområde konstrueras med hjälp av en "bäst i klassen"-metod ("filtrerat investeringsområde"): Företag i den nedre kvartilen efter branschjusterade ESG-betyg (enligt definitionen från MSCI) 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 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. 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 nedviktnings 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 uteslutningspolicier (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar.

### ***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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 förvaltrade 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 investeringsbesluts 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-taxonomin 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](http://www.amundi.lu)

Nej



#### Investeringsstrategin

styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

#### Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

#### Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI ACWI IMI Smart Cities ESG 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 utesluter företag som ligger efter med miljö, sociala frågor och bolagsstyrning ("ESG") i förhållande till temats område.

#### 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 förvaltnad 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) ("överordnat index"). Det väljer företag som bedöms ha hög exponering mot affärsverksamheter som: – smart anslutning (IoT) – smart infrastruktur – smarta byggnader – smarta hem – smart säkerhet – smart mobilteknik – smart vatten- och avfallshantering – 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) ("överordnat index"), 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 definitionen från MSCI) 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-principer och – företag som



saknar ESG-betyg (enligt MSCI). f) Ett filtrerat investeringsområde konstrueras med hjälp av en "bäst i klassen"-metod ("filtrerat investeringsområde"): Företag i den nedre kvartilen efter branschjusterade ESG-betyg (enligt definitionen från MSCI) 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 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. 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.amundiethf.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.

● ***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 kommer att uppfylla 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.



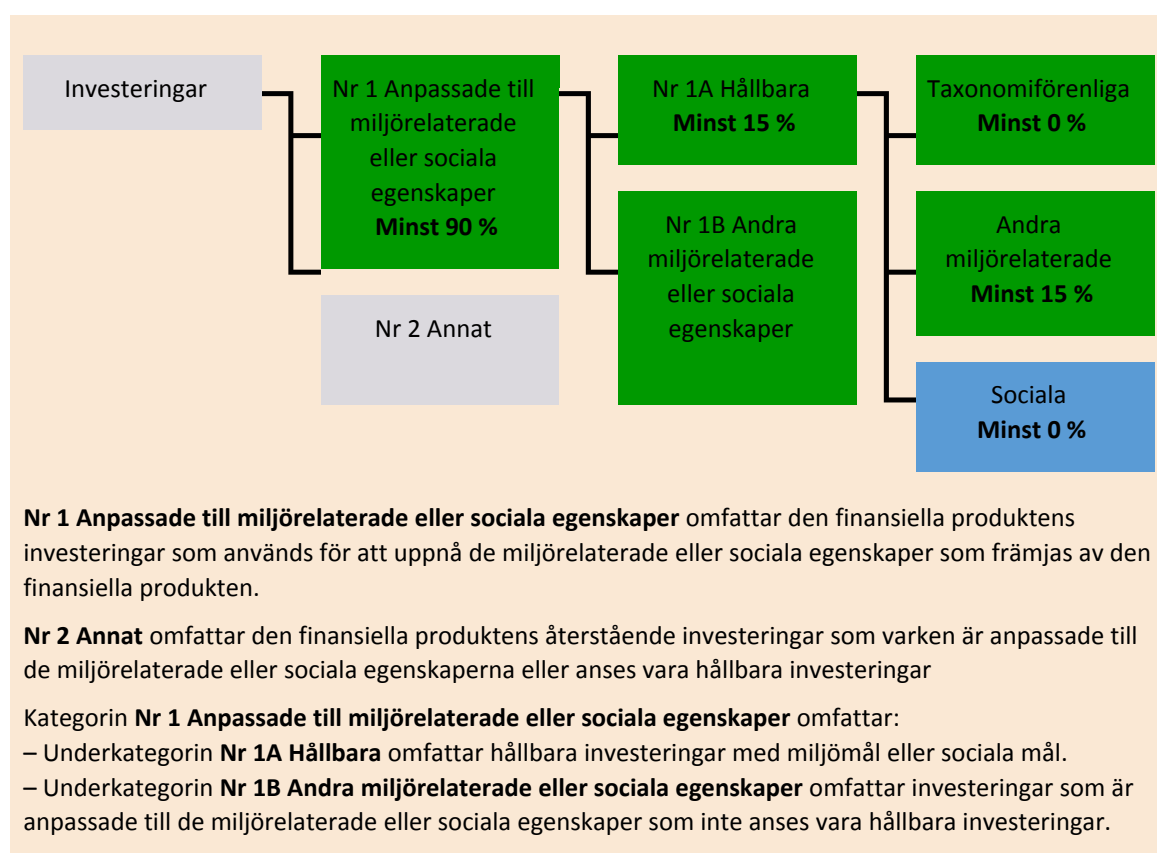
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

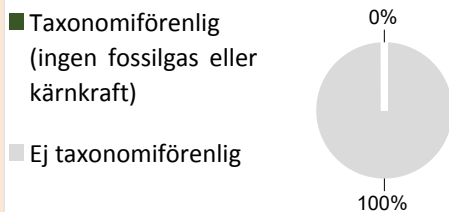
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnenergi enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag 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?**

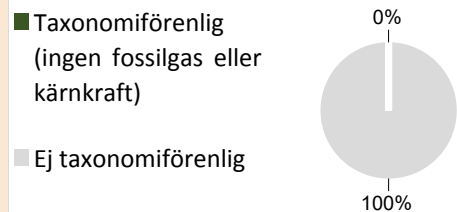
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnenergi
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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 referensvärdet 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 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](http://www.MSCI.com)



### **Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**

Mer information om delfonden finns på [www.amundietf.com](http://www.amundietf.com).

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

Amundi MSCI EM Asia ESG CTB Net Zero Ambition

Identifieringskod för juridiska personer:

## 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 10 % 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 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.

### 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. MSCI Japan ESG Broad CTB Select Index sätts samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimistandarderna i förordningen för EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt. Närmare bestämt sätts MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Index ("indexet") samman genom att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimistandarderna i förordningen för EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet. 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 borrhning 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 minimistandarderna i förordningen för EU-referensvärden för klimatomställning om minskning av koldioxidavtrycket – 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 det överordnade indexet 3. 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. 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 "presteras bäst" inom sin verksamhetssektor i minst en av dess väsentliga miljömässiga eller sociala faktorer.

Definitionen av att "presteras bäst" grundas på Amundis egenutvecklade ESG-metod som syftar till att mäta ESG-resultat hos ett investeringsobjekt. För att anses "presteras 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](http://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 investeringsbesluts 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-taxonomin 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 den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), integration av ESG-betyg, 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.
  - 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfonden följer resultatet för MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select ("indexet") och minimerar den aktiva risken mellan delfondens substansvärde och indexets resultat. MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EM Asia Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapper för stora och medelstora bolag på tillväxtmarknadsländer i Asien. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktat 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).

### ● **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 förvaltnad 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 att tillämpa en kombination av värdebaserade uteslutningar och en optimeringsprocess för att öka ESG-betyget jämfört med det överordnade indexet och för att uppfylla minimistandarderna i förordningen för EU-referensvärden för klimatomställning samtidigt som man siktar på en liknande riskprofil som det överordnade indexet, enligt närmare beskrivning i bilaga 1 – ESG-relaterade upplysningar till detta prospekt. MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select 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 det överordnade indexet. 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 borrhning 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 minimistandarderna i förordningen för EU-referensvärden för klimatomställning om minskning av koldioxidavtrycket – 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 det överordnade indexet 3. 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. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (normativa och sektoriella) som beskrivs närmare i Amundis policy för ansvarsfulla investeringar. Produktstrategin förlitar sig även på systematiska uteslutningspolicier (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?**

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 kommer att uppfylla 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.



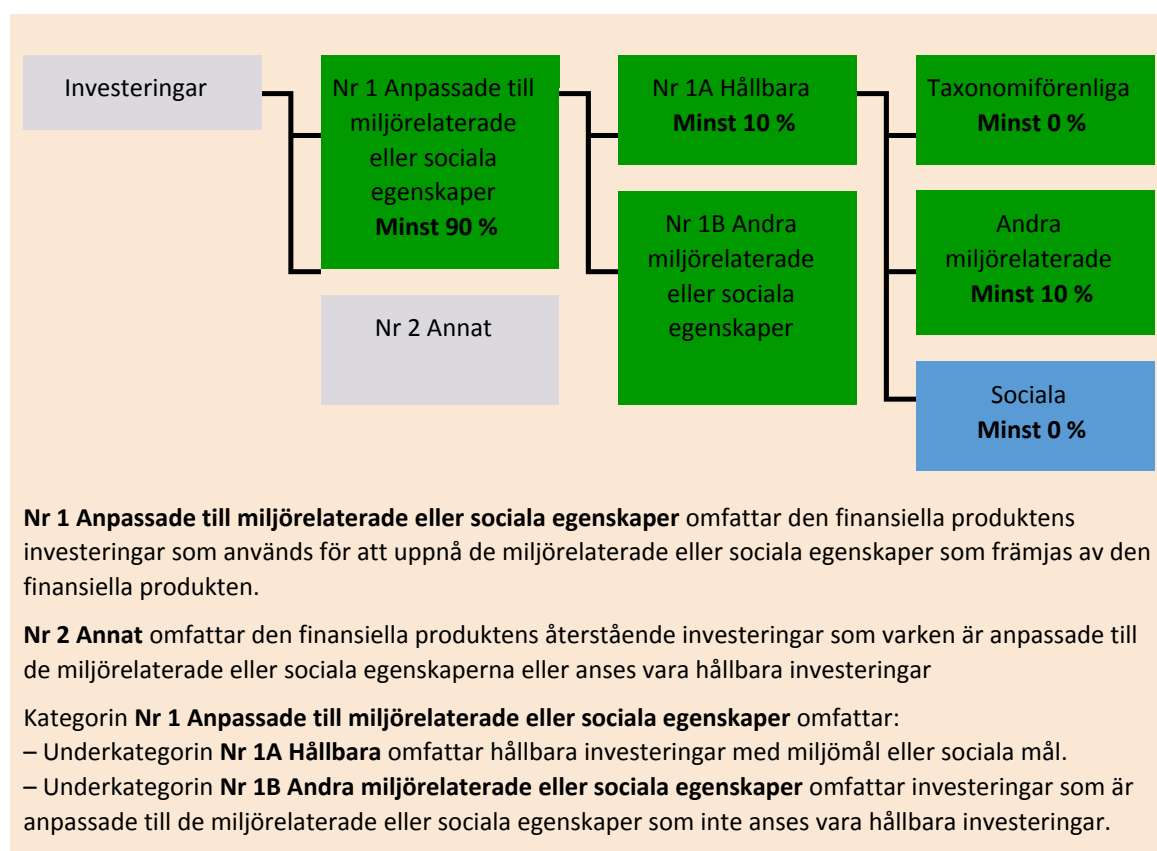
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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 (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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 10 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



## Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

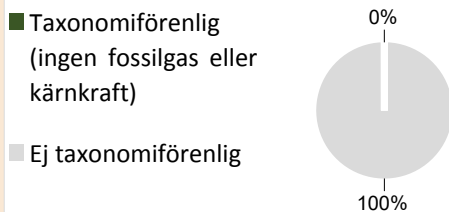
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

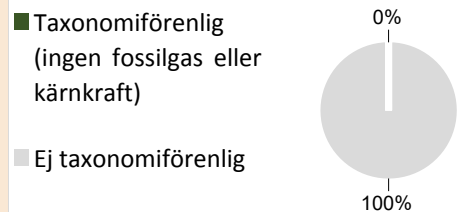
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

MSCI EM Asia ESG Broad CTB Select Index är ett aktieindex som är baserat på MSCI EM Asia Index ("överordnat index"), som motsvarar värdepapper för stora och medelstora bolag på tillväxtmarknadsländer i Asien. Indexet utesluter företag vars produkter har negativ social påverkan eller miljöpåverkan och ger större vikt till bolag med höga MSCI ESG-betyg. Dessutom syftar indexet till att representera resultatet för en strategi som viktas 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](http://www.MSCI.com)



### **Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**

Mer information om delfonden finns på [www.amundi-etf.com](http://www.amundi-etf.com).

Ansvarsfriskrivning

15/05/2024.

#### 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.



#### Hållbarhetsindikatorer

mäter hur de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar uppnås.

Produktnamn:

AMUNDI GLOBAL CORPORATE SRI 1-5Y HIGHEST RATED

Identifieringskod för juridiska personer:

## 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 % 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).

### ● 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 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. Mer information om MSCI ESG-betyg finns på följande länk: <https://www.msci.com/documents/1296102/21901542/ESG-Ratings-Methodology-Exec-Summary.pdf>. Mer 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>. Mer exakt tillämpar Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1–5 Year 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 (högre Ticker ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet) – MSCI ESG-kontroversbetyg (högre Ticker-kontroversbetyg 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. 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](https://www.bloomberg.com/indices) 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, 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](https://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 investeringsbesluts 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-taxonomin 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 den finansiella produktens strategi och förlitar sig på en kombination av uteslutningspolicyer (normativa och sektoriella), integration av ESG-betyg, 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.
  - 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](http://www.amundi.lu)

Nej



**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Delfondens mål är att följa resultatet för Bloomberg MSCI Global Corporate A+ ESG Sustainability SRI 1–5 Year 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.

### **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 förvaltdad 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 frånminst 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 (högre Ticker ESG-betyg ges företräde till att bli kvar i indexet) – MSCI ESG-kontroversbetyg (högre Ticker-kontroversbetyg 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. 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.

För mer information om affärsområden/verksamheter och urval, se den indexmetod som finns tillgänglig på [bloombergindices.com](https://www.bloomberg.com/indices) Produktstrategin bygger också 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?**

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 kommer att uppfylla 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.



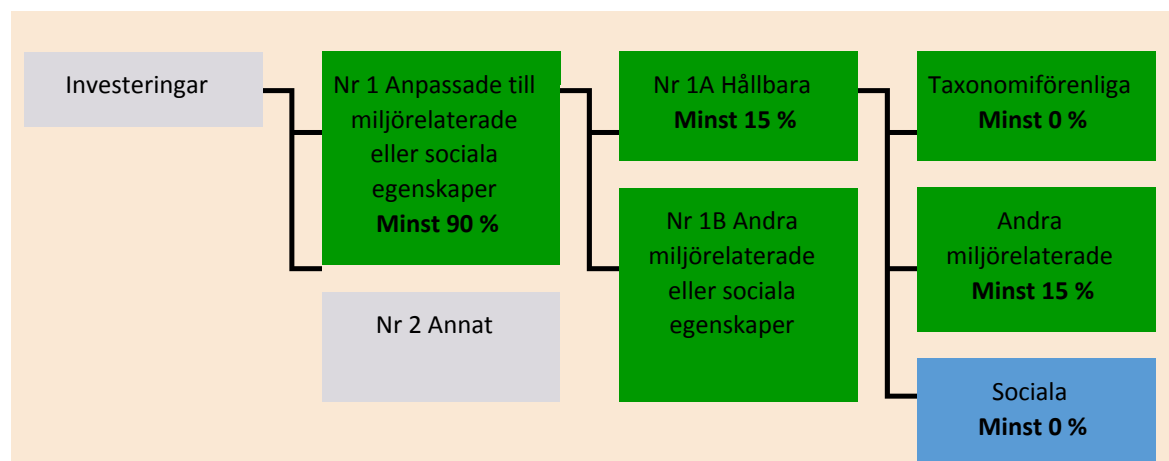
**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

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 % av delfondens värdepapper och instrument kommer att uppfylla 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). Den planerade andelen övriga miljöinvesteringar utgör minst 15 % (i) och kan ändras då de faktiska andelarna taxonomiförenliga och/eller sociala investeringar ökar.



**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

Derivat används inte för att uppnå de miljörelaterade och sociala egenskaper som delfonden främjar.

### Möjliggörande

verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

### Omställningsverksamhe

ter 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.



## Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

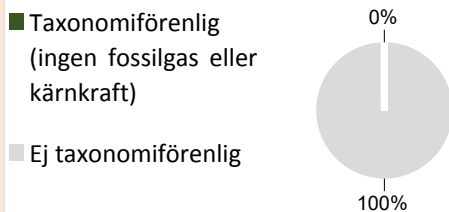
Delfonden har för närvarande inget lägsta åtagande gällande investeringar med ett miljömål som är förenligt med EU-taxonomin. Delfonden åtar sig inte att göra taxonomiförenliga investeringar i fossil gas eller kärnkraft enligt nedan. Som en del av investeringsstrategin kan den dock investera i företag som även är verksamma inom dessa branscher. Sådana investeringar kan, men inte nödvändigtvis vara taxonomiförenliga.

### ● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas eller kärnkraftrelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

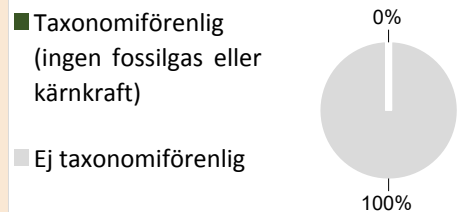
- ☐ Ja:
- ☐ I fossilgas ☐ I kärnkraft
- ☒ Nej

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.

#### 1. Investeringars anpassning till taxonomin inklusive statsobligationer\*



#### 2. Investeringars anpassning till taxonomin exklusive statsobligationer\*



Detta diagram visar 100 % av de totala investeringarna.\*\*

\* 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 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 Övrigt" 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 de finansiella produkterna uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som de 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 indexsponsor (inklusive BMR) bör indexsponsor 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?**

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: [www.bloomberg.com](http://www.bloomberg.com)



### **Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?**

Mer information om delfonden finns på <https://www.amundiethf.com>.