

AMUNDI ETF ICAV

Un veicolo irlandese di gestione collettiva del risparmio di tipo aperto, costituito come fondo multicomparto con separazione delle passività tra i comparti e a capitale variabile. L'ICAV è stato registrato ai sensi delle leggi irlandesi con numero di registrazione C461194.

SECONDO DOCUMENTO AGGIUNTIVO AL PROSPETTO

1 maggio 2025

Il presente Documento aggiuntivo contiene informazioni specifiche relative ai seguenti comparti di Amundi ETF ICAV (l'**ICAV**):

1. AMUNDI S&P GLOBAL COMMUNICATION SERVICES ESG UCITS ETF
2. AMUNDI S&P GLOBAL CONSUMER DISCRETIONARY ESG UCITS ETF
3. AMUNDI S&P GLOBAL CONSUMER STAPLES ESG UCITS ETF
4. AMUNDI S&P GLOBAL ENERGY CARBON REDUCED UCITS ETF
5. AMUNDI S&P GLOBAL FINANCIALS ESG UCITS ETF
6. AMUNDI S&P GLOBAL HEALTH CARE ESG UCITS ETF
7. AMUNDI S&P GLOBAL INDUSTRIALS ESG UCITS ETF
8. AMUNDI S&P GLOBAL INFORMATION TECHNOLOGY ESG UCITS ETF
9. AMUNDI S&P GLOBAL MATERIALS ESG UCITS ETF
10. AMUNDI S&P GLOBAL UTILITIES ESG UCITS ETF

(i "**Comparti**")

Il presente Documento aggiuntivo è un'integrazione, fa parte del prospetto dell'ICAV datato 24 marzo 2025 (il Prospetto) e deve essere letto insieme a esso.

Gli Amministratori dell'ICAV i cui nomi appaiono nella sezione intitolata "Amministratori dell'ICAV" del Prospetto si assumono la responsabilità delle informazioni contenute nel presente Documento aggiuntivo. A giudizio degli Amministratori, i quali hanno adottato ogni ragionevole cura al riguardo, le informazioni contenute nel presente documento sono conformi ai fatti e non presentano omissioni tali da alterarne il senso.

Le parole ed espressioni definite nel Prospetto avranno lo stesso significato quando utilizzate nel presente Documento aggiuntivo, salvo che il contesto non richieda diversamente. Ai fini dell'interpretazione, in caso di conflitto tra il presente Documento aggiuntivo e il Prospetto, tale conflitto sarà risolto a favore del primo.

SCOPO

Lo scopo del presente Documento aggiuntivo è aggiornare il Prospetto per includere la descrizione dei Comparti nella sezione intitolata "Descrizioni dei Comparti" e apportare alcune altre modifiche correlate al Prospetto.

AMUNDI S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Communication Services Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Communication Services Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei servizi di comunicazione attive nei mercati sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società di servizi di comunicazione sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dei servizi di comunicazione comprende società che facilitano la comunicazione e offrono contenuti e informazioni correlati attraverso vari canali diversi. Sono incluse società di telecomunicazioni e società di media e intrattenimento, comprensive di società produttrici di gaming interattivi e società di produzione e distribuzione di contenuti e di informazione tramite piattaforme esclusive. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario

- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario
*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/.

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'Indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDSECUN

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario
Cambio
Concentrazione
Derivati
Fondo di investimento
Gestione
Liquidità del mercato di quotazione
Mercato
Rischi ESG
Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte
Liquidità
Operativo
Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Commissioni annue	
					Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCI ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCI ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZAZIONE O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRECTI O CONSEQUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD COMMUNICATION SERVICES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI

AMUNDI S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Consumer Discretionary Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Consumer Discretionary Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei beni di consumo di non immediata necessità, definiti discrezionali (Consumer Discretionary), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nel settore Consumer Discretionary sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il segmento manifatturiero del settore Consumer Discretionary include produzione automobilistica, di beni casalinghi durevoli, attrezzature per il tempo libero, tessile e abbigliamento. Il segmento relativo ai servizi comprende alberghi, ristoranti e altre strutture per il tempo libero, società di produzione e servizi nel comparto media, distribuzione al dettaglio e servizi ai consumatori. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDSEDUN

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario
Cambio
Concentrazione
Derivati
Fondo di investimento
Gestione
Liquidità del mercato di quotazione
Mercato
Rischi ESG
Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte
Liquidità
Operativo
Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Commissioni annue	
					Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Gli importi minimi indicati si applicano in USD o nell'importo equivalente espresso nella valuta della Classe di Azioni interessata

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCI ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCI ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZAZIONE O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRETTI O CONSEQUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD CONSUMER DISCRETIONARY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI

AMUNDI S&P WORLD CONSUMER STAPLES SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Consumer Staples Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Consumer Staples Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei beni di consumo di base o primari (Consumer Staples), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nel settore Consumer Staples sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore Consumer Staples include società di produzione e distribuzione di alimenti, bevande e tabacco, prodotti per la persona e beni non durevoli per la casa. Include inoltre la distribuzione al dettaglio di alimentari e medicinali e la grande distribuzione (ipermercati e super centri commerciali). L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario

- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati. Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDESUN

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli

e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario
Cambio
Concentrazione
Derivati
Fondo di investimento
Gestione
Liquidità del mercato di quotazione
Mercato
Rischi ESG
Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte
Liquidità
Operativo
Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Commissioni annue	
					Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Gli importi minimi indicati si applicano in USD o nell'importo equivalente espresso nella valuta della Classe di Azioni interessata

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD CONSUMER STAPLES SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCI ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCI ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZAZIONE O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRECTI O CONSEGUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD CONSUMER STAPLES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI.

AMUNDI S&P WORLD ENERGY SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Energy Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Energy Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'energia, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società dell'energia sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore energetico comprende società impegnate nell'esplorazione e nella produzione, raffinazione e commercializzazione, nonché nello stoccaggio e nel trasporto di petrolio e gas e di carbone e carburanti di consumo. Include anche società che offrono attrezzature e servizi per il settore petrolifero e del gas. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'Indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDSEUN

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle

operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario

Cambio

Concentrazione

Derivati

Fondo di investimento

Gestione

Liquidità del mercato di quotazione

Mercato

Rischi ESG

Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte

Liquidità

Operativo

Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Commissioni annue	
					Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD ENERGY SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCI ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCI ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZAZIONE O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRECTI O CONSEQUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD ENERGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI.

AMUNDI S&P WORLD FINANCIALS SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Financials Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Financials Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore finanziario, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore finanziario sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore finanziario comprende società che svolgono attività bancaria, operatori del risparmio e del credito ipotecario, operatori di finanza specializzata, finanziarie di credito al consumo, società di gestione patrimoniale e banche di custodia, banche di investimento e società di brokeraggio e assicurazione. Include inoltre gli operatori di scambi e dati finanziari nonché i fondi immobiliari REIT (Real Estate Investment Trust) ipotecari. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è SPDFSEFUN.

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di

pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

- Azionario
- Cambio
- Concentrazione
- Derivati
- Fondo di investimento
- Gestione
- Liquidità del mercato di quotazione
- Mercato
- Rischi ESG
- Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

- Controparte
- Liquidità
- Operativo
- Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

					Commissioni annue	
Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

S&P WORLD FINANCIALS SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCI ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCI ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZAZIONE O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRECTI O CONSEGUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD FINANCIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATO DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI.

AMUNDI S&P WORLD HEALTH CARE SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Health Care Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Health Care Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'assistenza sanitaria, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nell'assistenza sanitaria sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dell'assistenza sanitaria include la fornitura di assistenza sanitaria e di servizi per la salute, l'attività di produzione e distribuzione di attrezzature e forniture mediche, e le società di tecnologia per l'assistenza sanitaria. Inoltre esso comprende società operanti nella ricerca, sviluppo, produzione e commercializzazione di prodotti farmaceutici e di biotecnologie. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati. Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDSEHUN

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

Per la metodologia, la composizione, le norme di ribilanciamento degli indici S&P, e per ulteriori informazioni sui componenti sottostanti l'Indice, consultare il sito: <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i

Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario

Cambio

Concentrazione

Derivati

Fondo di investimento

Gestione

Liquidità del mercato di quotazione

Mercato

Rischi ESG

Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte

Liquidità

Operativo

Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

					Commissioni annue	
Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD HEALTH CARE SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCIA ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCIA ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZABILITÀ O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRETTI O CONSEGUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD HEALTH CARE WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI.

AMUNDI S&P WORLD INDUSTRIALS SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Industrials Weighted & Screened Index ("Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Industrials Index ("Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore industriale, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore industriale sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore industriale include i produttori e distributori di beni strumentali quali prodotti del comparto aeronautico e della difesa, prodotti per l'edilizia, apparecchiature e macchinari elettrici e società che offrono servizi di costruzione e ingegneria. Il settore comprende inoltre i fornitori di servizi commerciali e professionali quali servizi di stampa, servizi e strutture per l'ambiente, servizi e forniture per l'ufficio, servizi di sicurezza e sistemi di allarme, risorse umane e servizi per l'impiego, servizi di ricerca e consulenza. Sono altresì incluse le società che offrono servizi di trasporto. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDSEIUN

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i

Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

- Azionario
- Cambio
- Concentrazione
- Derivati
- Fondo di investimento
- Gestione
- Liquidità del mercato di quotazione
- Mercato
- Rischi ESG
- Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

- Controparte
- Liquidità
- Operativo
- Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

					Commissioni annue	
Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD INDUSTRIALS SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCI ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCI ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZABILITÀ O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRECTI O CONSEGUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD INDUSTRIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI.

AMUNDI S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Information Technology Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Information Technology Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'Information Technology (IT), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società IT sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore IT, o delle tecnologie dell'informazione, comprende società di software e servizi informatici, di produzione e distribuzione di hardware e apparecchiature tecnologiche quali apparecchi di comunicazione, telefoni cellulari, computer, apparecchiature elettroniche e semiconduttori. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDSETUN.

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario
Cambio
Concentrazione
Derivati
Fondo di investimento
Gestione
Liquidità del mercato di quotazione
Mercato
Rischi ESG
Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte
Liquidità
Operativo
Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Commissioni annue	
					Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCIA ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCIA ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZAZIONE O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRETTI O CONSEGUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD INFORMATION TECHNOLOGY WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHI TALI DANNI.

AMUNDI S&P WORLD MATERIALS SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Materials Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Materials Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei materiali, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore dei materiali sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dei materiali include società produttrici di prodotti chimici, materiali da costruzione, vetro, carta, prodotti forestali e relativi materiali da imballaggio, nonché società metallurgiche, industrie di lavorazione ed estrazione mineraria, incluso acciaierie. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario

- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPSEMUN.

La performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>.

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Oiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario
Cambio
Concentrazione
Derivati
Fondo di investimento
Gestione
Liquidità del mercato di quotazione
Mercato
Rischi ESG
Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte
Liquidità
Operativo
Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Commissioni annue	
					Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD MATERIALS SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCIA ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCIA ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZABILITÀ O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRETTI O CONSEGUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD MATERIALS WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI

AMUNDI S&P WORLD UTILITIES SCREENED UCITS ETF

Obiettivo e politica di investimento

Comparto: Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF (il "Comparto")

Indice: L'S&P World Utilities Weighted & Screened Index (l'"Indice")

Il Comparto è un prodotto finanziario che promuove, tra le altre, caratteristiche ESG ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa.

Nella sezione "Descrizione dell'Indice" sono contenute informazioni sulla coerenza dell'Indice con le caratteristiche ambientali, sociali e di governance.

Obiettivo di investimento

Replicare la performance dell'Indice.

Descrizione dell'Indice

- Descrizione generale dell'Indice

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Utilities Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore delle utilities, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società di utilities sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore delle utilities comprende società fornitrici di elettricità, gas e acqua. Include inoltre produttori indipendenti di energia elettrica e trader di energia nonché società operanti nella generazione e distribuzione di energia elettrica da fonti rinnovabili. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

- Valuta dell'indice: Dollaro statunitense
- Composizione dell'Indice

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/.

- Revisione dell'Indice

Il ribilanciamento dell'Indice è pianificato trimestralmente.

- Pubblicazione dell'Indice

L'indice è calcolato e pubblicato da Standard & Poor's ("S&P").

L'Indice è calcolato da S&P sulla base dei prezzi di chiusura ufficiali delle borse valori su cui i componenti dell'Indice sono negoziati.

Il valore dell'Indice è disponibile tramite Bloomberg. Alla data del prospetto, il relativo ticker è: SPDSEUUN.

la performance replicata è il prezzo di chiusura dell'Indice.

La metodologia, la composizione, le regole di ribilanciamento dell'Indice S&P e informazioni aggiuntive sui componenti sottostanti all'indice sono disponibili su <https://www.spglobal.com/spdji/en/supplemental-data/europe/>

Processo di gestione

Il Comparto è gestito in base a un approccio passivo e l'esposizione all'Indice sarà ottenuta mediante Replica diretta, effettuando principalmente investimenti diretti in valori mobiliari e/o altre attività idonee, come ulteriormente descritto di seguito, rappresentative dei componenti dell'Indice in una proporzione estremamente simile a quella dell'Indice, come descritto più dettagliatamente nella sezione intitolata "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. Ad eccezione degli investimenti consentiti in opzioni e strumenti finanziari derivati swap OTC (come descritto più dettagliatamente in "Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati" (di seguito) e contanti, gli investimenti del Comparto saranno costituiti da titoli azionari e strumenti finanziari a essi collegati che saranno quotati e negoziati su mercati regolamentati. Al fine di replicare l'Indice, il Comparto può investire fino al 20% del suo Valore Patrimoniale Netto in azioni emesse dallo stesso ente. Questo limite può essere aumentato al 35% per un singolo emittente in presenza di condizioni di mercato eccezionali (ad esempio quando la ponderazione dell'emittente nell'Indice viene aumentata a seguito della posizione di mercato dominante dell'emittente o a seguito di una fusione).

Il Comparto integra i rischi di sostenibilità e tiene conto dei principali effetti negativi degli investimenti sui fattori di sostenibilità nel proprio processo di investimento, come descritto più dettagliatamente nella sezione "Investimento sostenibile" del presente Prospetto e non deterrà titoli di società coinvolte nella produzione o nella vendita di armi controverse o di società che violano le convenzioni internazionali sui diritti umani o dei lavoratori oppure di società coinvolte in settori controversi, quali tabacco, carbone termico, armi nucleari o petrolio e gas non convenzionali in base a quanto stabilito nella sezione "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo". Maggiori informazioni sul Regolamento sulla Tassonomia e su questo Comparto sono disponibili nella sezione "Investimenti sostenibili" del Prospetto. Ulteriori informazioni in relazione all'applicazione del Regolamento sull'informativa sono contenute nell'Allegato 1 – Informativa ESG.

Tracking Error

Il Tracking Error misura la volatilità della differenza tra il rendimento del Comparto e quello dell'Indice. In condizioni di mercato normali, si prevede che il Comparto seguirà la performance dell'Indice con un Tracking Error fino all'1%.

Tecniche e strumenti utilizzabili con titoli e derivati

Al fine di gestire afflussi e deflussi, nonché alcune specificità del mercato azionario locale (tra cui accesso al mercato, liquidità o questioni fiscali locali), il Gestore degli Investimenti può investire in future, opzioni e swap correlati ad azioni comprese nell'Indice o comunque compatibili con l'Obiettivo di investimento del Comparto. In questo caso, il Comparto può detenere depositi mantenendo al contempo la piena esposizione all'Indice.

Il Comparto può ricorrere a tecniche e strumenti di gestione efficiente del portafoglio in relazione a valori mobiliari e a strumenti del mercato monetario, quali accordi di prestito titoli e contratti di pronti contro termine e di pronti contro termine inverso ai fini di una gestione efficiente del portafoglio, secondo quanto descritto e previsto nelle sezioni intitolate "Tecniche e strumenti relativi alle operazioni di finanziamento tramite titoli" e "Metodi di replica per i Comparti gestiti in modo passivo" del presente Prospetto. In particolare, tali tecniche e strumenti possono essere utilizzati per generare reddito aggiuntivo per il Comparto.

Le proporzioni massime previste delle attività del Comparto che possono essere soggette a SFT sono specificate nella tabella "Utilizzo di Operazioni di finanziamento tramite titoli e Total return swap".

Valuta base: Euro

Gestore degli Investimenti

Amundi Asset Management

Rischi principali

Per maggiori informazioni, vedere "Descrizione dei rischi".

Rischi legati a condizioni di mercato ordinarie

Il Comparto può avere una volatilità più elevata a causa della sua esposizione ai mercati azionari.

Azionario
Cambio
Concentrazione
Derivati
Fondo di investimento
Getione
Liquidità del mercato di quotazione
Mercato
Rischi ESG
Rischio di copertura (Classe di Azioni Hedged)

Rischi legati a condizioni di mercato inusuali

Controparte
Liquidità
Operativo
Pratiche operative standard

Esposizione globale e metodologia di calcolo

Per ulteriori informazioni, vedere "Esposizione globale e leva finanziaria"

Profilo dell'investitore tipico

Il Comparto è ideato per gli investitori consapevoli dei rischi posti dal Comparto e disposti a mantenere il loro investimento per almeno cinque anni. Questo Comparto è indicato per gli investitori che:

- cercano una crescita dell'investimento nel lungo periodo
- mirano a replicare la performance dell'Indice, accettando al contempo i rischi e la volatilità associati

Dettagli della transazione

Giorno lavorativo Ogni giorno della settimana diverso da Capodanno, Venerdì Santo, Lunedì di Pasqua, 1° maggio (Festa dei lavoratori), Natale e 26 dicembre (o altro giorno stabilito di volta in volta dagli Amministratori previa comunicazione agli Azionisti).

Giorno di transazione Ogni Giorno lavorativo sarà un Giorno di transazione. Tuttavia, i Giorni lavorativi in cui, a esclusiva discrezione del Gestore degli Investimenti, i mercati nei quali gli Investimenti del Comparto sono quotati o negoziati o i mercati pertinenti per l'Indice sono chiusi e pertanto una parte sostanziale dell'Indice non può essere negoziata, non saranno Giorni di transazione. I giorni che non sono Giorni di transazione per l'anno in corso sono disponibili su <https://www.amundi.ie>. Gli Amministratori possono stabilire di volta in volta altri giorni come Giorni di transazione, previa notifica a tutti gli Azionisti.

Termine ultimo di negoziazione Le 18:30 (CET) del Giorno lavorativo antecedente al relativo Giorno di transazione.

Momento di valutazione Chiusura delle attività nell'ultimo mercato di riferimento in ciascun Giorno di transazione.

Data di regolamento Le quote di sottoscrizione o i titoli devono pervenire entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione. Il regolamento dei proventi del rimborso o dei titoli sarà di norma effettuato entro due Giorni lavorativi successivi al relativo Giorno di transazione.

Giorno di pubblicazione del NAV: Giorno di transazione +1

PRINCIPALI CLASSI DI AZIONI E RELATIVE COMMISSIONI

					Commissioni annue	
Classe di azioni	Cambio	Politica dei dividendi (A)/(D)	Importo minimo di sottoscrizione*	Importo minimo di rimborso*	Gestione (max)	Amministrazione (max)
UCITS ETF Acc	EUR	(A)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%
UCITS ETF Dist	EUR	(D)	100.000 USD	100.000 USD	0,08%	0,10%

* Questi minimi sono applicati in USD o nell'importo equivalente nella valuta della rispettiva classe di azioni

Clausola di esclusione di responsabilità del fornitore dell'indice

AMUNDI S&P WORLD UTILITIES SCREENED UCITS ETF NON È SPONSORIZZATO, GARANTITO, COMMERCIALIZZATO O PROMOSSO DA STANDARD & POOR'S NÉ DA SUOI AFFILIATI ("S&P"). S&P NON RILASCIA ALCUNA DICHIARAZIONE, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, AI TITOLARI DEL COMPARTO O A QUALSIASI ALTRO SOGGETTO, IN MERITO ALL'OPPORTUNITÀ DI INVESTIRE IN TITOLI IN GENERALE O NEL COMPARTO IN PARTICOLARE O ALLA CAPACITÀ DELL'S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX DI REPLICARE LA PERFORMANCE DI MERCATI FINANZIARI E/O LORO SEGMENTI E/O DI GRUPPI O CLASSI DI ATTIVITÀ. L'UNICO RAPPORTO TRA S&P E AMUNDI È LA CONCESSIONE IN LICENZA DA PARTE DI S&P DI ALCUNI MARCHI, DENOMINAZIONI COMMERCIALI E DELL'S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX, CHE È DETERMINATO, COMPOSTO E CALCOLATO DA S&P INDIPENDENTEMENTE DA AMUNDI O DAL COMPARTO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO DI TENERE CONTO DELLE ESIGENZE DI AMUNDI O DEGLI INVESTITORI NELLA DETERMINAZIONE, COMPOSIZIONE O NEL CALCOLO DELL'S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX. S&P NON È RESPONSABILE E NON HA PARTECIPATO ALLA DETERMINAZIONE DEI PREZZI E DEL NAV DEL COMPARTO, ALLE TEMPISTICHE DI EMISSIONE O COLLOCAMENTO DELLO STESSO O ALLA DETERMINAZIONE E AL CALCOLO DELL'EQUAZIONE CON CUI LE AZIONI DEL COMPARTO SONO CONVERTITE IN DENARO. S&P NON HA ALCUN OBBLIGO O RESPONSABILITÀ IN RELAZIONE ALL'AMMINISTRAZIONE, ALLA COMMERCIALIZZAZIONE O ALLA NEGOZIAZIONE DEL COMPARTO.

S&P NON GARANTISCE L'ACCURATEZZA E/O LA COMPLETEZZA DELL'S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO; S&P NON HA INOLTRE ALCUNA RESPONSABILITÀ PER ERRORI, OMISSIONI O SOSPENSIONI DI TALE INDICE. S&P DECLINA QUALSIASI RESPONSABILITÀ, CONDIZIONE O GARANZIA, ESPLICITA O IMPLICITA, IN MERITO AI RISULTATI CHE POSSONO ESSERE OTTENUTI DA AMUNDI, DAGLI INVESTITORI O DA QUALSIVOGLIA ALTRA PERSONA FISICA O GIURIDICA TRAMITE L'UTILIZZO DELL'S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. S&P NON RILASCIA ALCUNA GARANZIA, DICHIARAZIONE O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA E DECLINA ESPRESSAMENTE QUALSIASI GARANZIA O CONDIZIONE DI COMMERCIALIZZABILITÀ O DI IDONEITÀ PER UN PARTICOLARE SCOPO O UTILIZZO E QUALSIASI ALTRA GARANZIA O CONDIZIONE ESPLICITA O IMPLICITA IN RELAZIONE ALL'S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX O A QUALSIASI DATO IVI INCLUSO. FERMO RESTANDO QUANTO PRECEDE, IN NESSUN CASO S&P AVRÀ ALCUNA RESPONSABILITÀ PER DANNI SPECIALI, PUNITIVI, INDIRETTI O CONSEGUENZIALI (INCLUSI I MANCATI PROFITTI) DERIVANTI DALL'USO DELL'S&P WORLD UTILITIES WEIGHTED & SCREENED INDEX O DI QUALSIASI DATO IVI INCLUSO, ANCHE SE INFORMATI DELLA POSSIBILITÀ CHE SI VERIFICHIANO TALI DANNI

Modello di informativa precontrattuale per i prodotti finanziari di cui all'articolo 8, paragrafi 1, 2 e 2 bis, del regolamento (UE) 2019/2088 e all'articolo 6, primo comma, del regolamento (UE) 2020/852

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**. Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.

Nome del prodotto:

Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:

213800MUCC8T65PPGV54

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di **investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale** pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di **investimenti sostenibili con un obiettivo sociale** pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 10% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Communication Services Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Communication Services Index (l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto

dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia.

L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG scores contiene un punteggio ESG score complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

- 1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;*
- 2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione;*
- 3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali;*
- 4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.*
- 5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.*

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario*
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario*

** Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su <https://www.spglobal.com/spdji/>*

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DSNH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla corruzione attiva e passiva.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani?*
Descrizione particolareggiata:

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio.

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Communication Services Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Communication Services Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei servizi di comunicazione attive nei "Mercati Sviluppati" (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società di servizi di comunicazione sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dei servizi di comunicazione comprende società che facilitano la comunicazione e offrono contenuti e informazioni correlati attraverso vari canali diversi. Sono incluse società di telecomunicazioni e società di media e intrattenimento, comprensive di società produttrici di gaming interattivi e società di produzione e distribuzione di contenuti e di informazione tramite piattaforme esclusive. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale di S&P World Communication Services Weighted & Screened dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione;
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali;
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● ***Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?***

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● ***Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?***

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

L'**allocazione degli attivi** descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

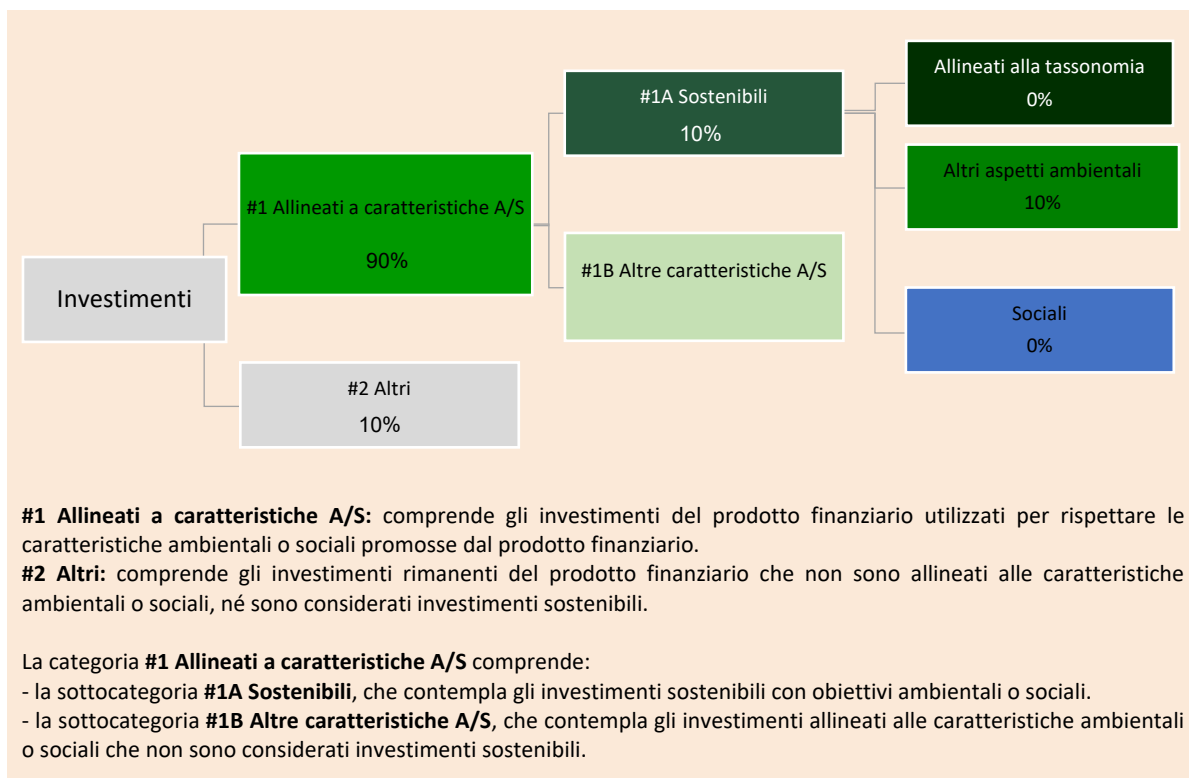
Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere almeno il 10% di Investimenti Sostenibili, in base al grafico seguente.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



● **In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?**

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.



In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

- **Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE¹?**

Sì:

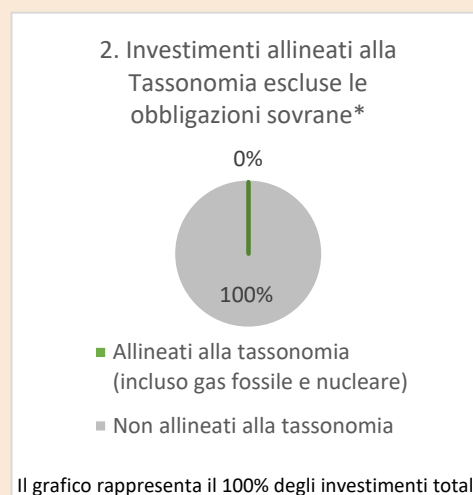
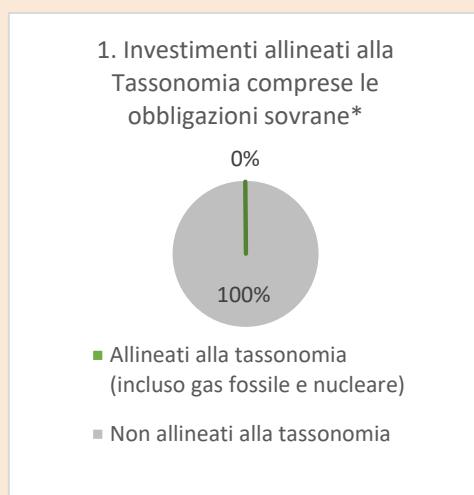
Gas fossile

Energia nucleare

No

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale. Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.

I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane* alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.




* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

- **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

I fondi non prevedono una quota minima di investimenti in attività di transizione o attività abilitanti.

¹ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.



Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 10% in totale



Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 10% in totale



Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

Gli indici di riferimento sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Communication Services Index (l'Indice originario). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei servizi di comunicazione attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società di servizi di comunicazione sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dei servizi di comunicazione comprende società che facilitano la comunicazione e offrono contenuti e informazioni correlati attraverso vari canali diversi. Sono incluse società di telecomunicazioni e società di media e intrattenimento, comprensive di società produttrici di gaming interattivi e società

di produzione e distribuzione di contenuti e di informazione tramite piattaforme esclusive. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

● ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/



Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?

Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**. Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.

Nome del prodotto:

Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:

213800QD7NI9LMMJ8D95

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 15% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Consumer Discretionary Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Consumer Discretionary Index (l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e

di governance e ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia. L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani?*
Descrizione particolareggiata:

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli

analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Consumer Discretionary Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Consumer Discretionary Index (l'"Indice originario").

L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei beni di consumo di non immediata necessità, definiti discrezionali (Consumer Discretionary), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nel settore Consumer Discretionary sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il segmento manifatturiero del settore Consumer Discretionary include produzione automobilistica, di beni casalinghi durevoli, attrezzature per il tempo libero, tessile e abbigliamento. Il segmento relativo ai servizi comprende alberghi, ristoranti e altre strutture per il tempo libero, società di produzione e servizi nel comparto media, distribuzione al dettaglio e servizi ai consumatori. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario

- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● **Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?**

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● **Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?**

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere una quota minima del 15% in Investimenti Sostenibili secondo il grafico che segue.

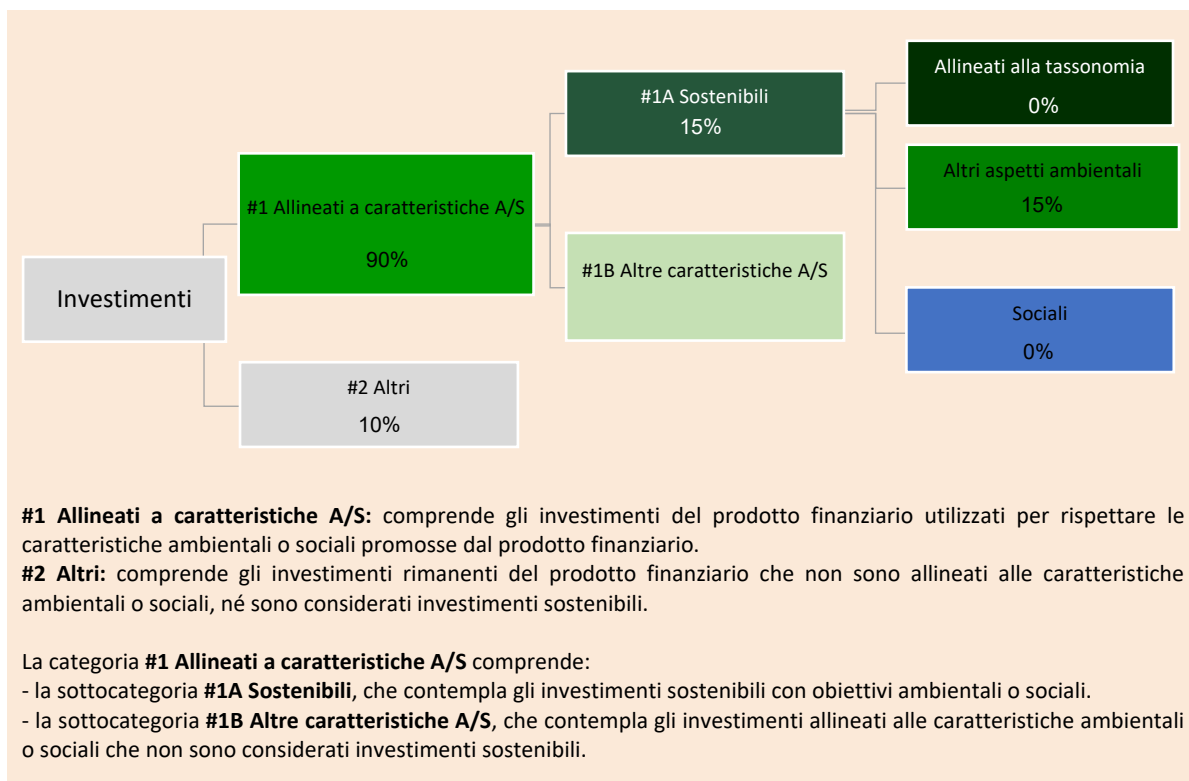
L'**allocazione degli attivi** descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale** (CapEx): investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative** (OpEx): attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



● ***In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.

 **In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?**

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

● ***Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE²?***

Sì:

Gas fossile

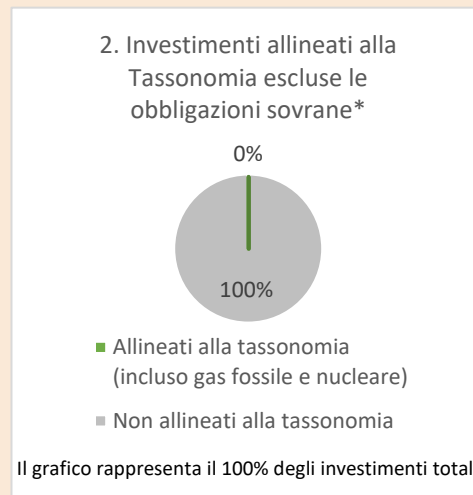
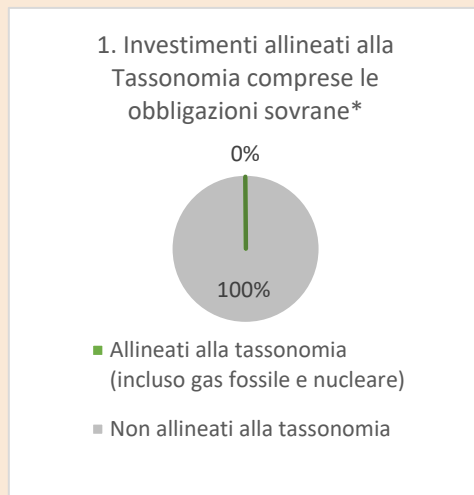
Energia nucleare

No

² Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale. Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.


I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

● Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?

I fondi non prevedono una quota minima di investimenti in attività di transizione o attività abilitanti.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.

Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 15% in totale

Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 15% in totale

Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

Gli indici di riferimento sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Consumer Discretionary Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei beni di consumo di non immediata necessità, definiti discrezionali (Consumer Discretionary), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nel settore Consumer Discretionary sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il segmento manifatturiero del settore Consumer Discretionary include produzione automobilistica, di beni casalinghi durevoli, attrezzature per il tempo libero, tessile e abbigliamento. Il segmento relativo ai servizi comprende alberghi, ristoranti e altre strutture per il tempo libero, società di produzione e servizi nel comparto media, distribuzione al dettaglio e servizi ai consumatori. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

- ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/



Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?

Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Nome del prodotto:

Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:

213800SD9FSVIM73191

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 15% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**.

Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Consumer Staples Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World

Consumer Staples Index (l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Il Comparto promuove caratteristiche ambientali e/o sociali attraverso l'integrazione di un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG").

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● ***Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?***

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia. L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediante) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdij/

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei

combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani? Descrizione particolareggiata:*

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali

catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Consumer Staples Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Consumer Staples Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei beni di consumo di base o primari (Consumer Staples), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nel settore Consumer Staples sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore Consumer Staples include società di produzione e distribuzione di alimenti, bevande e tabacco, prodotti per la persona e beni non durevoli per la casa. Include inoltre la distribuzione al dettaglio di alimentari e medicinali e la grande distribuzione (ipermercati e super centri commerciali). L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su

criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● ***Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?***

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● ***Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?***

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

L'allocazione degli attivi descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

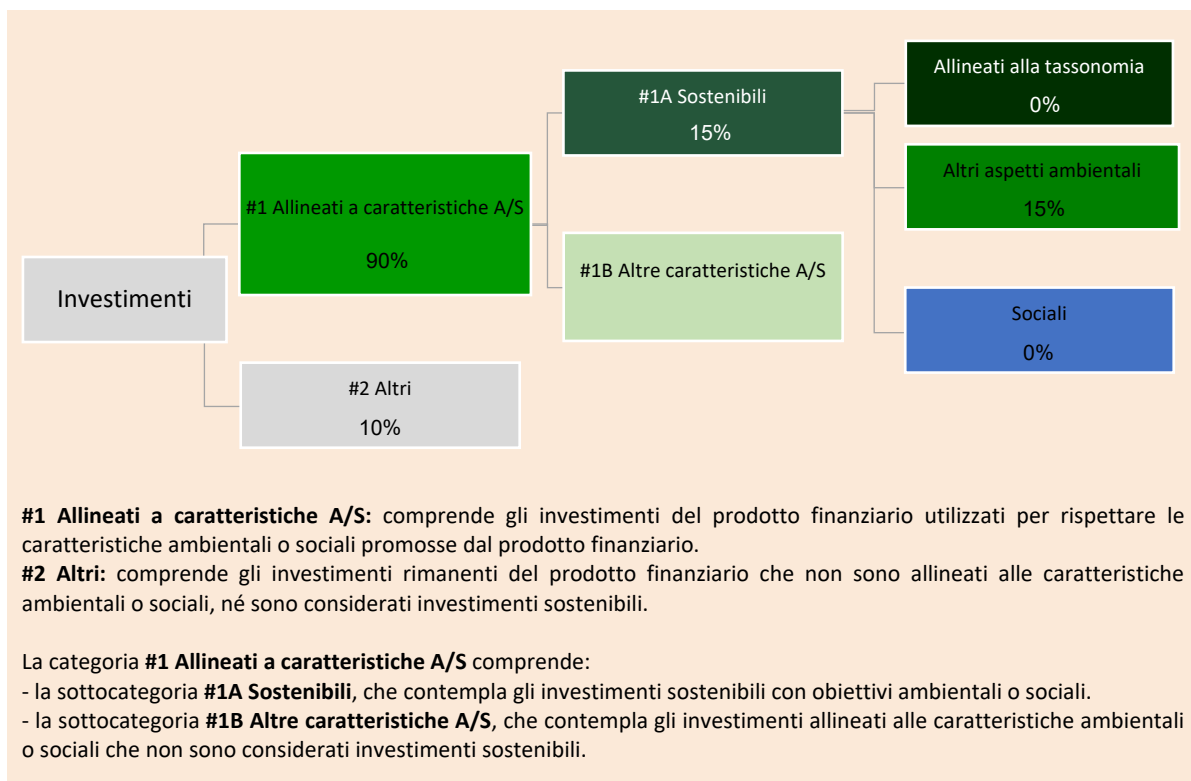
Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere una quota minima del 15% in Investimenti Sostenibili secondo il grafico che segue.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.



In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

- **Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE³?**

Sì:

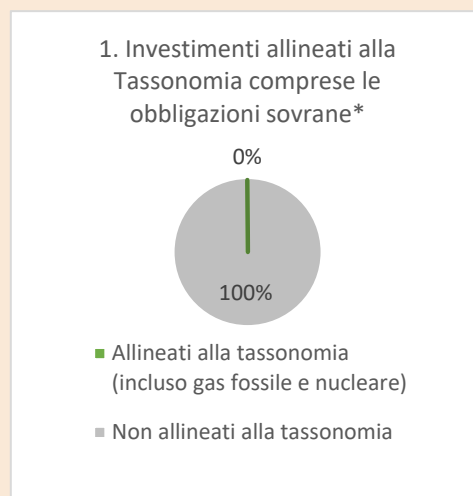
Gas fossile

Energia nucleare

No

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale. Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.

I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

- **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

I fondi non prevedono una quota minima di investimenti in attività di transizione o attività abilitanti.

³ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.



sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.



Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 15% in totale



Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 15% in totale



Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Gli indici di riferimento sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Consumer Staples Index (l'Indice originario). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei beni di consumo di base o primari (Consumer Staples), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nel settore Consumer Staples sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore Consumer Staples include società di produzione e distribuzione di alimenti, bevande e tabacco, prodotti per la persona e beni non durevoli per la casa. Include inoltre la

distribuzione al dettaglio di alimentari e medicinali e la grande distribuzione (ipermercati e super centri commerciali). L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario. L'Indice è un indice a rendimento totale netto, il che significa che i dividendi al netto delle imposte corrisposti dai componenti dell'indice sono inclusi nel rendimento dello stesso.

● ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/



Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?

Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Nome del prodotto:
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:
2138006GH96S2Y7QT243

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?

Sì

No

Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%

in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE

in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE

Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%

Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) ___0% di investimenti sostenibili

con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE

con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE

con un obiettivo sociale

Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**. Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Energy Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Energy Index

(l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia.

L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario.
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdij/.

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani?*
Descrizione particolareggiata:

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie

vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Energy Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Energy Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'energia, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società dell'energia sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore energetico comprende società impegnate nell'esplorazione e nella produzione, raffinazione e commercializzazione, nonché nello stoccaggio e nel trasporto di petrolio e gas e di carbone e carburanti di consumo. Include anche società che offrono attrezzature e servizi per il settore petrolifero e del gas. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione;
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali;
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario.

- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/..

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di buona governance comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● ***Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?***

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● ***Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?***

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

L'**allocazione degli attivi** descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

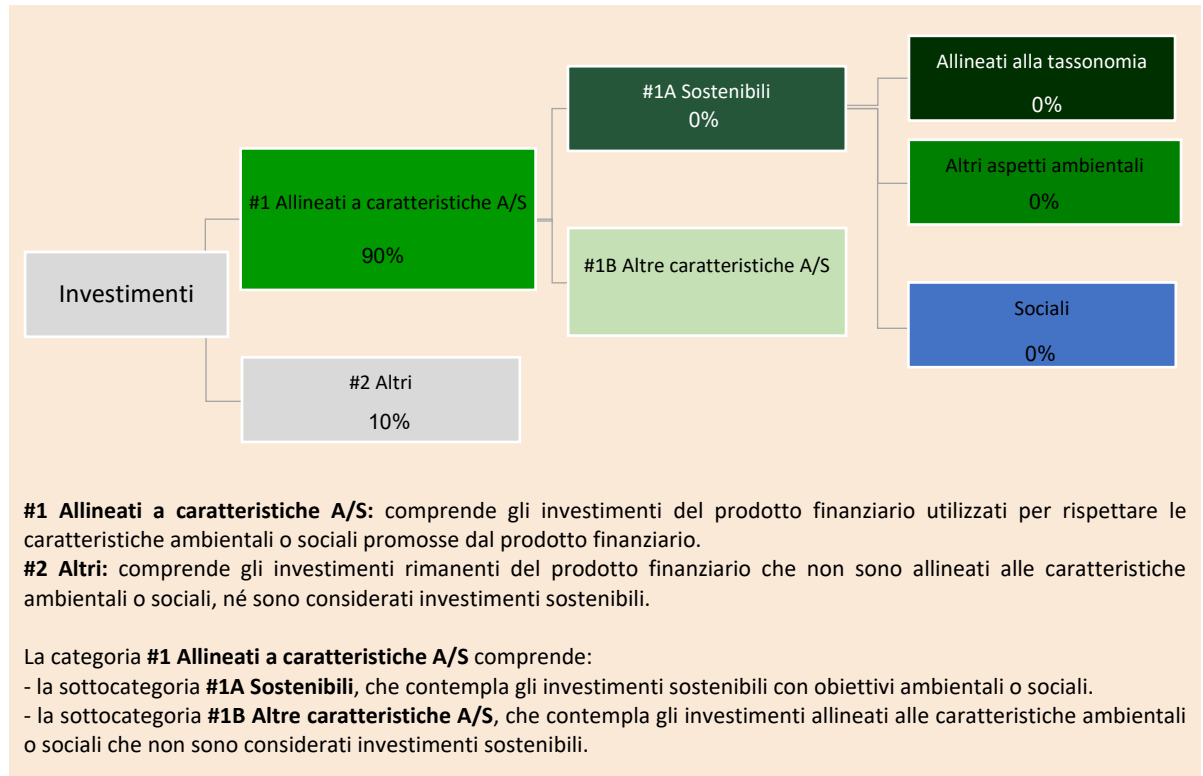
Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere almeno lo 0% di Investimenti Sostenibili, in base al grafico seguente.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.



In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

- **Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE⁴?**

Sì:

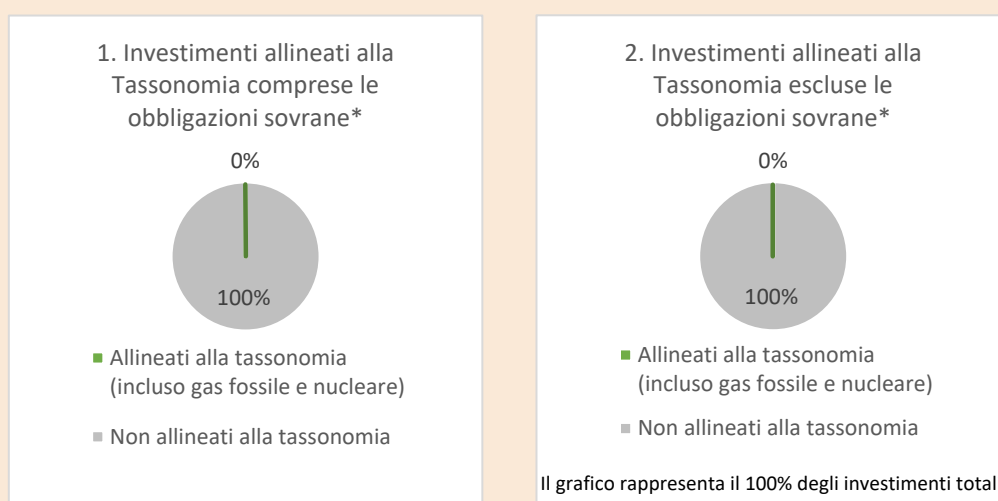
Gas fossile

Energia nucleare

No

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale. Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.

I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

- **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

I fondi non prevedono una quota minima di investimenti in attività di transizione o attività abilitanti.

⁴ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.



sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.



Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale



Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti socialmente sostenibili.



Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

Gli indici di riferimento sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Energy Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'energia, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società dell'energia sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore energetico comprende società impegnate nell'esplorazione e nella produzione, raffinazione e commercializzazione, nonché nello stoccaggio e nel trasporto di petrolio e gas e di carbone e carburanti di consumo. Include anche società che offrono attrezzature e

servizi per il settore petrolifero e del gas. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

- ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/



Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?

Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundieftf.com.

Nome del prodotto:

Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:

213800MIUWZSPFK4LM72

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) ___1%___ di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**. Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Financials Weighted & Screened Index ("Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Financials Index

(l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.

- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia. L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.

2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.

3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.

4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.

5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario

- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/.

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani? Descrizione particolareggiata:*

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie

vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Financials Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Financials Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore finanziario, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore finanziario sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore finanziario comprende società che svolgono attività bancaria, operatori del risparmio e del credito ipotecario, operatori di finanza specializzata, finanziarie di credito al consumo, società di gestione patrimoniale e banche di custodia, banche di investimento e società di brokeraggio e assicurazione. Include inoltre gli operatori di scambi e dati finanziari nonché i fondi immobiliari REIT (Real Estate Investment Trust) ipotecari. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione;
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali;
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario

- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/.

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● **Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?**

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● **Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?**

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere una quota minima dell'1% in Investimenti Sostenibili secondo il grafico che segue.

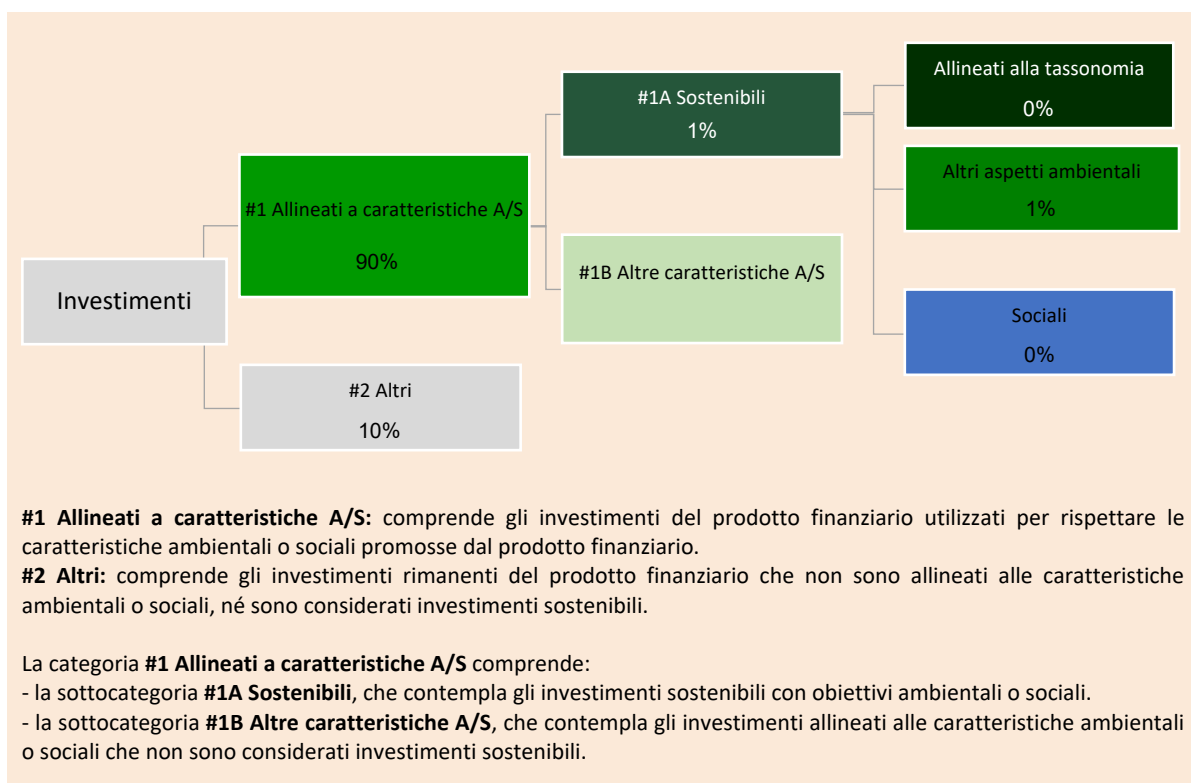
L'**allocazione degli attivi** descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



● ***In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.

 **In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?**

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

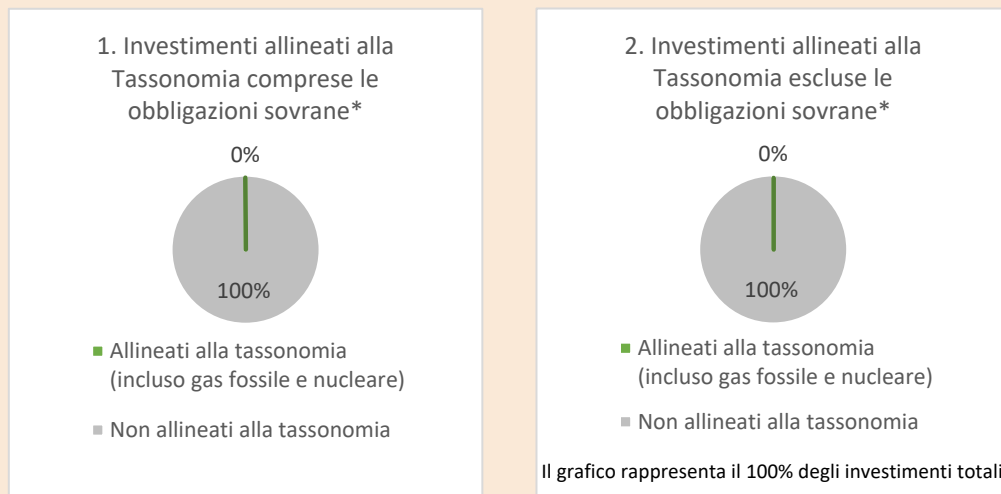
● ***Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE⁵?***

- Sì:
- Gas fossile Energia nucleare
- No

⁵ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale. Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.


I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

● **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

I fondi non prevedono una quota minima di investimenti in attività di transizione o attività abilitanti.


 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.

 **Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?**

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari all'1% in totale

 **Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?**

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari all'1% in totale

 **Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?**

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Gli indici di riferimento sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

● ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

● ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

● ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Financials Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore finanziario, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore finanziario sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore finanziario comprende società che svolgono attività bancaria, operatori del risparmio e del credito ipotecario, operatori di finanza specializzata, finanziarie di credito al consumo, società di gestione patrimoniale e banche di custodia, banche di investimento e società di brokeraggio e assicurazione. Include inoltre gli operatori di scambi e dati finanziari nonché i fondi immobiliari REIT (Real Estate Investment Trust) ipotecari. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

● ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/



Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?

Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Nome del prodotto:

Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:

213800SNXMHGMQYREZ20

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 25% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**.

Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Health Care Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Health Care Index (l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

- La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:
- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
 - la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà complessivamente minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia. L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani? Descrizione particolareggiata:*

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, effettuiamo il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie

vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Health Care Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Health Care Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'assistenza sanitaria, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nell'assistenza sanitaria sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dell'assistenza sanitaria include la fornitura di assistenza sanitaria e di servizi per la salute, l'attività di produzione e distribuzione di attrezzature e forniture mediche, e le società di tecnologia per l'assistenza sanitaria. Inoltre esso comprende società operanti nella ricerca, sviluppo, produzione e commercializzazione di prodotti farmaceutici e di biotecnologie. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario. Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione;
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali;
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● **Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?**

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● **Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?**

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere una quota minima del 25% in Investimenti Sostenibili secondo il grafico che segue.

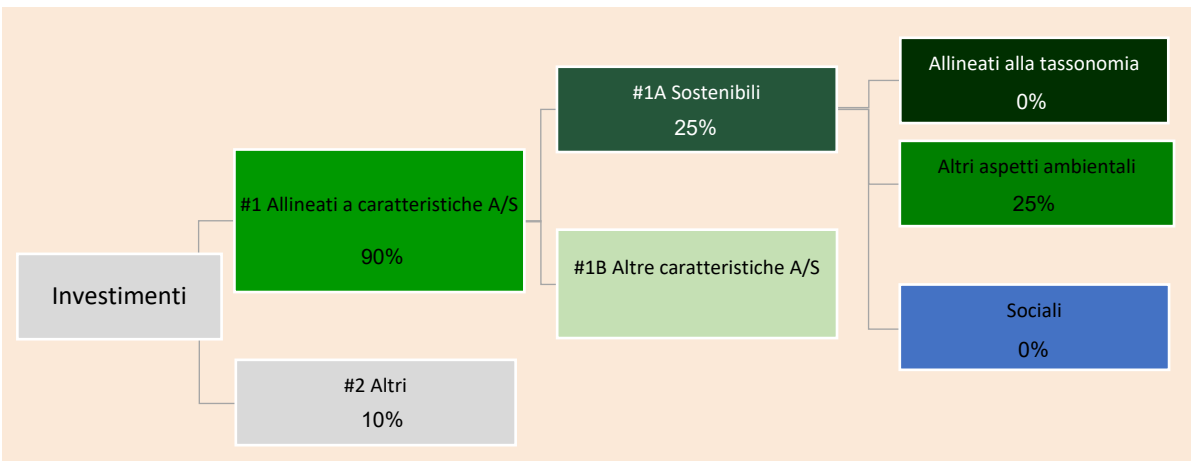
L'**allocazione degli attivi** descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



#1 Allineati a caratteristiche A/S: comprende gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per rispettare le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.
#2 Altri: comprende gli investimenti rimanenti del prodotto finanziario che non sono allineati alle caratteristiche ambientali o sociali, né sono considerati investimenti sostenibili.

La categoria **#1 Allineati a caratteristiche A/S** comprende:
 - la sottocategoria **#1A Sostenibili**, che contempla gli investimenti sostenibili con obiettivi ambientali o sociali;
 - la sottocategoria **#1B Altre caratteristiche A/S**, che contempla gli investimenti allineati alle caratteristiche ambientali o sociali che non sono considerati investimenti sostenibili.

● ***In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.

 **In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?**

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

● ***Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE⁶?***

Sì:

Gas fossile Energia nucleare

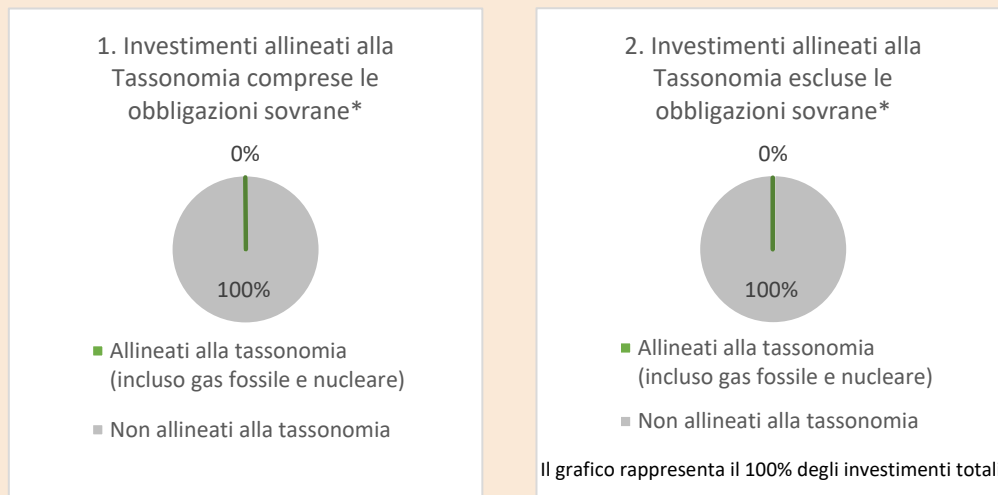
No

⁶ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.

Le attività abilitanti consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale.

Le attività di transizione sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.


I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

● **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

Il fondo non prevede una quota minima di investimenti in attività di transizione o in attività abilitanti.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.

 **Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?**

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 25% in totale

 **Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?**

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 25% in totale

 **Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?**

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

Gli indici di riferimento sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Health Care Index ("Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'assistenza sanitaria, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società operanti nell'assistenza sanitaria sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dell'assistenza sanitaria include la fornitura di assistenza sanitaria e di servizi per la salute, l'attività di produzione e distribuzione di attrezzature e forniture mediche, e le società di tecnologia per l'assistenza sanitaria. Inoltre esso comprende società operanti nella ricerca, sviluppo, produzione e commercializzazione di prodotti farmaceutici e di biotecnologie. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

- ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/



Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?

Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Nome del prodotto:
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:
2138009H295UEFKR3145

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 20% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**.

Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Industrials Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Industrials Index (l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre

l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● ***Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?***

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia.

L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DSNH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla corruzione attiva e passiva.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani? Descrizione particolareggiata:*

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie

vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Industrials Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Industrials Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore industriale, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore industriale sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore industriale include i produttori e distributori di beni strumentali quali prodotti del comparto aeronautico e della difesa, prodotti per l'edilizia, apparecchiature e macchinari elettrici e società che offrono servizi di costruzione e ingegneria. Il settore comprende inoltre i fornitori di servizi commerciali e professionali quali servizi di stampa, servizi e strutture per l'ambiente, servizi e forniture per l'ufficio, servizi di sicurezza e sistemi di allarme, risorse umane e servizi per l'impiego, servizi di ricerca e consulenza. Sono altresì incluse le società che offrono servizi di trasporto. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione;
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali;
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti

vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/.

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● ***Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?***

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● ***Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?***

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

L'allocazione degli attivi descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

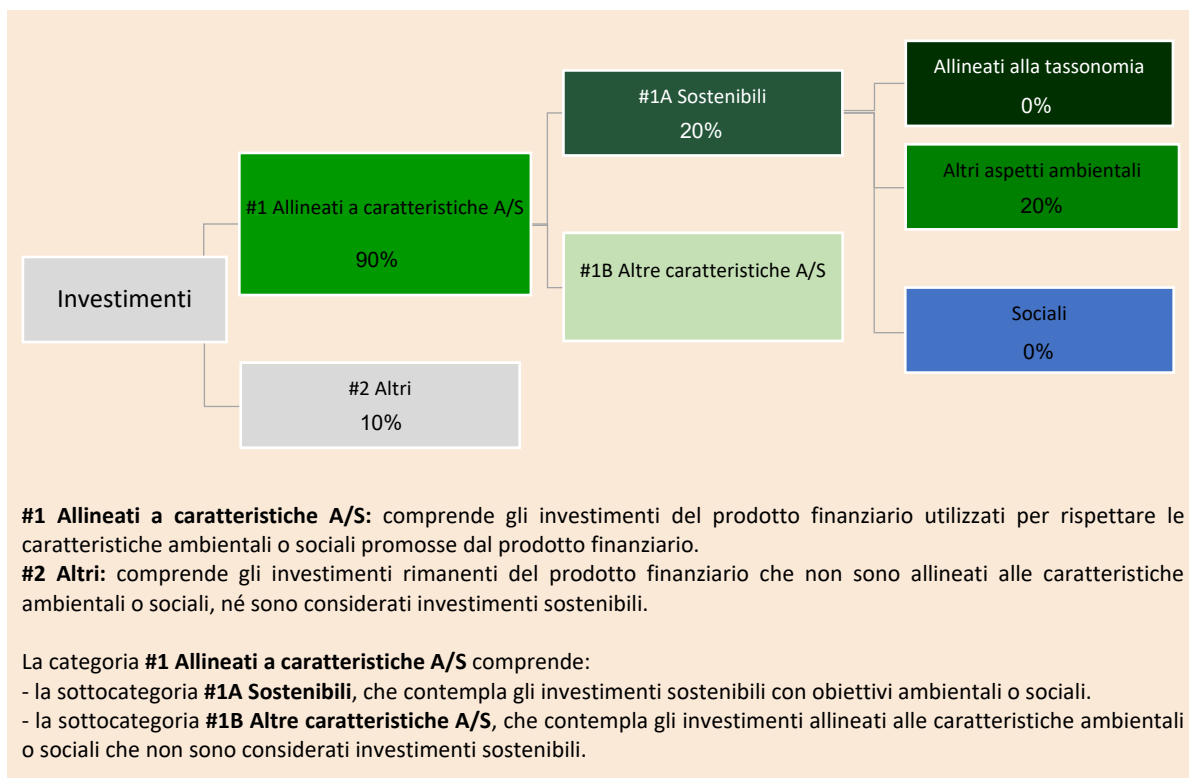
Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere una quota minima del 20% in Investimenti Sostenibili secondo il grafico che segue.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.



In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

- **Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE⁷?**

Sì:

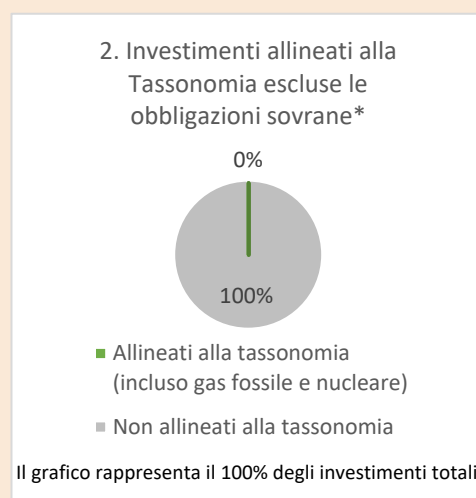
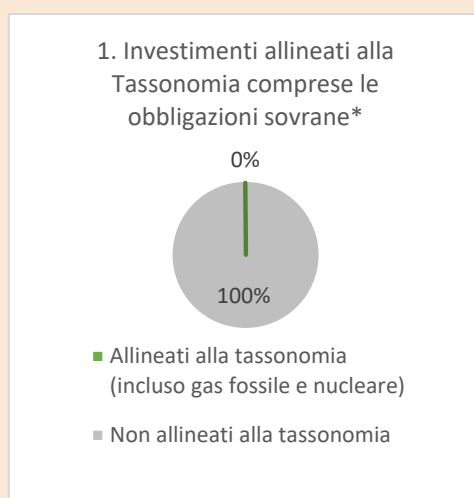
Gas fossile

Energia nucleare

No

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale. Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.

I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

- **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

Il fondo non prevede una quota minima di investimenti in attività di transizione o in attività abilitanti.

⁷ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.



sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.



Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 20% in totale



Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 20% in totale



Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

Gli indici di riferimento

sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Industrials Index (l'Indice originario). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore industriale, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore industriale sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore industriale include i produttori e distributori di beni strumentali quali prodotti del comparto aeronautico e della difesa, prodotti per l'edilizia, apparecchiature e macchinari elettrici e società che offrono servizi di costruzione e ingegneria.

Il settore comprende inoltre i fornitori di servizi commerciali e professionali quali servizi di stampa, servizi e strutture per l'ambiente, servizi e forniture per l'ufficio, servizi di sicurezza e sistemi di allarme, risorse umane e servizi per l'impiego, servizi di ricerca e consulenza. Sono altresì incluse le società che offrono servizi di trasporto. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

● ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/



Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?

Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**. Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.

Nome del prodotto:

Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:

213800GUG4M6SPEBIP04

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 30% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Information Technology Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World

Information Technology Index (l'"Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia. L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi.

Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani? Descrizione particolareggiata:*

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie

vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Information Technology Weighted & Screened Index (l'"Indice")L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Information Technology Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'Information Technology (IT), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società IT sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore IT, o delle tecnologie dell'informazione, comprende società di software e servizi informatici, di produzione e distribuzione di hardware e apparecchiature tecnologiche quali apparecchi di comunicazione, telefoni cellulari, computer, apparecchiature elettroniche e semiconduttori. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario. Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione;
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali;
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● **Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?**

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● **Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?**

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere una quota minima del 30% in Investimenti Sostenibili secondo il grafico che segue.

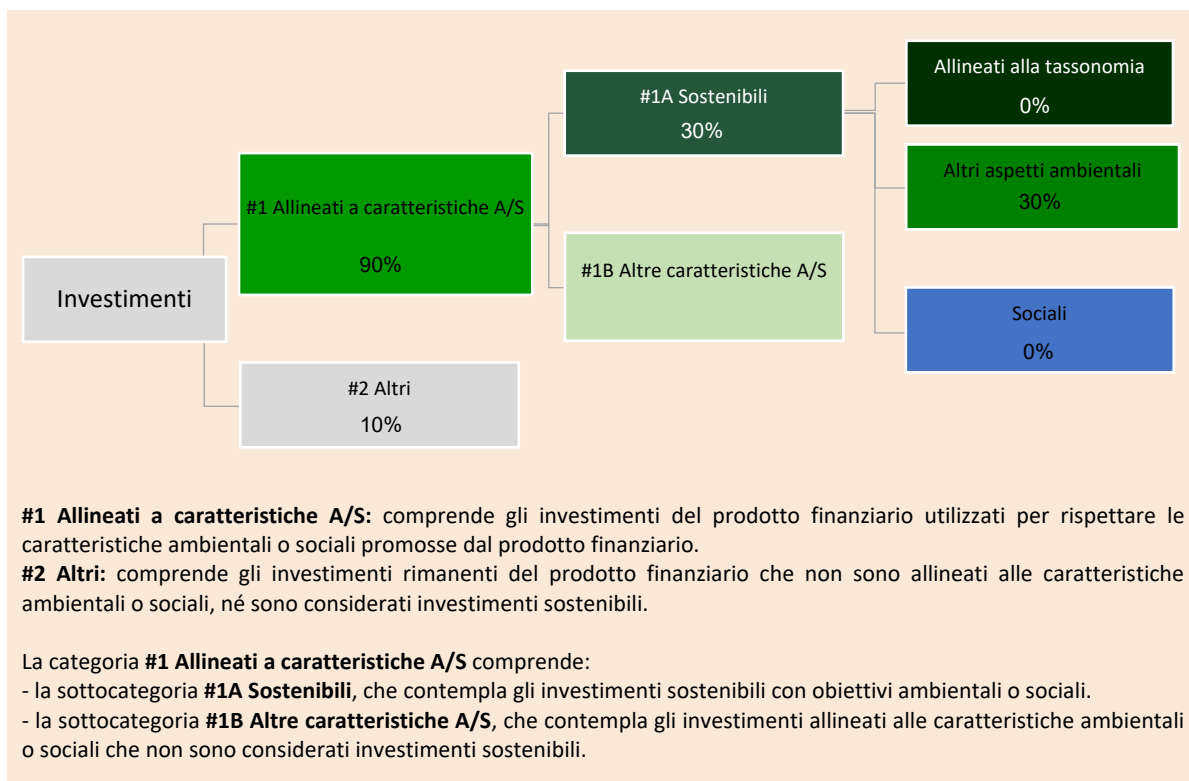
L'**allocazione degli attivi** descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



- ***In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.



In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

- ***Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE⁸?***

Sì:

Gas fossile

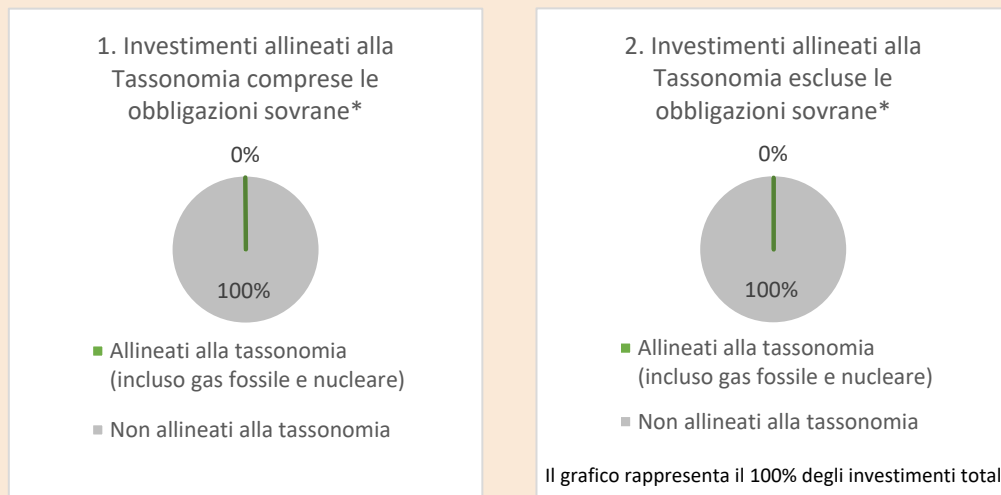
Energia nucleare

No

⁸ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale. Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.


I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane* alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

● **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

Il fondo non prevede una quota minima di investimenti in attività di transizione o in attività abilitanti.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.

 **Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?**

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 30% in totale

 **Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?**

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 30% in totale

 **Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?**

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Information Technology Index (l'Indice originario). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dell'Information Technology (IT), attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società IT sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore IT, o delle tecnologie dell'informazione, comprende società di software e servizi informatici, di produzione e distribuzione di hardware e apparecchiature tecnologiche quali apparecchi di comunicazione, telefoni cellulari, computer, apparecchiature elettroniche e semiconduttori. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

- ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/

Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?



Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Nome del prodotto:
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:
213800PVS4JGTSRLOF83

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 25% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**.

Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Materials Weighted & Screened Index ("Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Materials Index ("Indice originario") per soddisfare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre

l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● ***Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?***

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia. L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta alla

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani?*
Descrizione particolareggiata:

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie

vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Materials Weighted & Screened Index (l'"Indice").

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Materials Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei materiali, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore dei materiali sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dei materiali include società produttrici di prodotti chimici, materiali da costruzione, vetro, carta, prodotti forestali e relativi materiali da imballaggio, nonché società metallurgiche, industrie di lavorazione ed estrazione mineraria, incluso acciaierie. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La **strategia di investimento** guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● **Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?**

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● **Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?**

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere una quota minima del 25% in Investimenti Sostenibili secondo il grafico che segue.

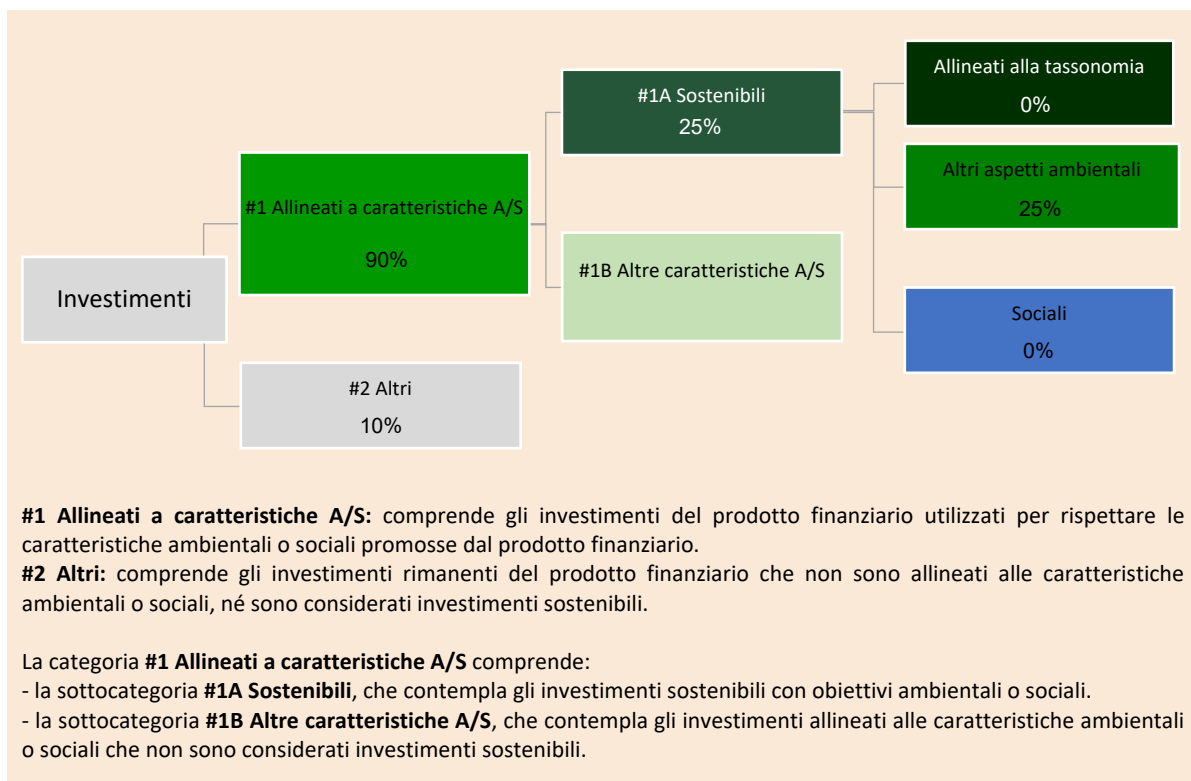
L'allocazione degli attivi descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale** (CapEx): investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative** (OpEx): attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



● ***In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.



In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

● ***Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE⁹?***

Sì:

Gas fossile

Energia nucleare

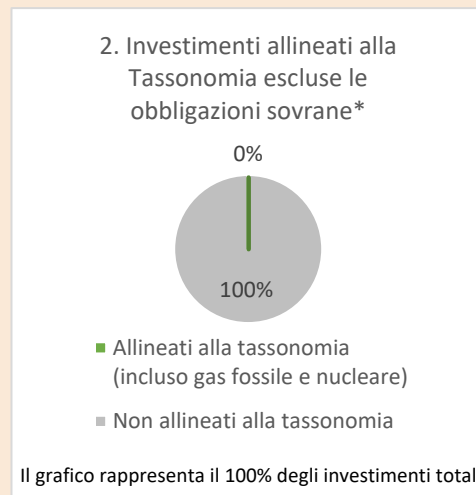
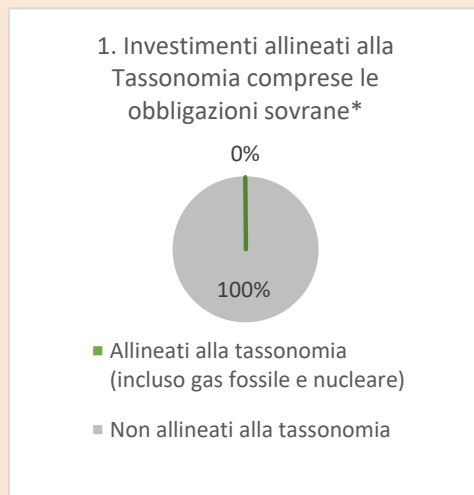
No

⁹ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.

Le **attività abilitanti** consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale.

Le **attività di transizione** sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.


I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

● Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?

I fondi non prevedono una quota minima di investimenti in attività di transizione o attività abilitanti.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.

Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 25% in totale

Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 25% in totale



Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

● ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

● ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

● ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Materials Index (l'Indice originario). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore dei materiali, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società del settore dei materiali sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore dei materiali include società produttrici di prodotti chimici, materiali da costruzione, vetro, carta, prodotti forestali e relativi materiali da imballaggio, nonché società metallurgiche, industrie di lavorazione ed estrazione mineraria, incluso acciaierie. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

● ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/

Dove è possibile reperire online informazioni più specificamente mirate al prodotto?



Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Gli indici di riferimento sono indici atti a misurare se il prodotto finanziario rispetti le caratteristiche ambientali o sociali che promuove.

Si intende per **investimento sostenibile** un investimento in un'attività economica che contribuisce a un obiettivo ambientale o sociale, a condizione che tale investimento non arrechi un danno significativo a nessun obiettivo ambientale o sociale e che l'impresa beneficiaria degli investimenti rispetti prassi di buona governance.

La **tassonomia dell'UE** è un sistema di classificazione istituito dal regolamento (UE) 2020/852, che stabilisce un elenco di **attività economiche ecosostenibili**. Tale regolamento non comprende un elenco di attività economiche socialmente sostenibili. Gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale potrebbero non risultare allineati alla tassonomia.

Nome del prodotto:
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF

Identificativo della persona giuridica:
213800Y8Q2JPGGCV3738

Caratteristiche ambientali e/o sociali

Questo prodotto finanziario ha un obiettivo di investimento sostenibile?



Sì



No



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale pari al(lo): ___%



in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



Effettuerà una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo sociale pari al(lo): ___%



Promuove caratteristiche ambientali/sociali (A/S) e, pur non avendo come obiettivo un investimento sostenibile, avrà una quota minima del(lo) 10% di investimenti sostenibili



con un obiettivo ambientale in attività economiche considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo ambientale in attività economiche che non sono considerate ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE



con un obiettivo sociale



Promuove caratteristiche A/S, ma non effettuerà alcun investimento sostenibile



Quali caratteristiche ambientali e/o sociali sono promosse da questo prodotto finanziario?

Il Comparto cerca di promuovere le seguenti caratteristiche ambientali e sociali:

- 1) riduzione dell'intensità delle emissioni di carbonio; e
- 2) riduzione della produzione di armi controverse e nucleari; e
- 3) riduzione dei danni ambientali derivanti da attività commerciali correlate a sabbie bituminose, carbone termico e petrolio e gas non convenzionali.

Il Comparto promuove queste caratteristiche ambientali e sociali attraverso, tra l'altro, la replica dell'S&P World Utilities Weighted & Screened Index (l'"Indice") che integra un rating ambientale, sociale e di governance ("ESG"). L'Indice è selezionato e pesato per migliorare la sua sostenibilità ambientale e sociale applicando una serie di filtri ai componenti dell'S&P World Utilities Index (l'"Indice originario") per soddisfare obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'impronta

di carbonio rispetto all'Indice originario, come descritto dettagliatamente di seguito.

La metodologia dell'Indice è costruita utilizzando un approccio inclinato:

- la ponderazione delle società con il miglior rating ESG sarà maggiore.
- la ponderazione delle società con il peggior rating ESG sarà minore.

Gli indicatori di sostenibilità misurano in che modo sono rispettate le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.

● **Quali indicatori di sostenibilità sono utilizzati per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Per misurare il rispetto di ciascuna delle caratteristiche ambientali e/o sociali promosse da questo prodotto finanziario vengono utilizzati i punteggi S&P Global ESG Scores.

S&P Global Sustainable fornisce punteggi ambientali, sociali e di governance (ESG) (collettivamente "S&P Global ESG Scores"), che misurano la performance complessiva delle società in relazione a fattori ESG finanziariamente rilevanti. I punteggi S&P Global ESG Scores sono l'aggregazione di punteggi relativi alle tre dimensioni: Ambientale, Sociale e Governance ed Economia.

L'insieme di dati dei punteggi S&P Global ESG contiene un punteggio ESG complessivo a livello di società per un esercizio finanziario che consiste in singoli punteggi sulla dimensione ambientale (E), sociale (S) e di governance (G), scomposti in (mediamente) più di 20 punteggi basati su criteri specifici per settore che possono essere utilizzati come segnali di rischi e ripercussioni ESG.

Più precisamente, l'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono il suo Indice originario.

Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico.
2. Esclusione delle società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, prassi commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG Score o miglioramento del punteggio S&P Global ESG Score rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/.

● **Quali sono gli obiettivi degli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare e in che modo l'investimento sostenibile contribuisce a tali obiettivi?**

Sebbene il Comparto non preveda investimenti sostenibili nel suo obiettivo, investirà una quota minima del suo patrimonio in investimenti sostenibili ai sensi dell'art. 2 (17) dell'SFDR che contribuiscono a un obiettivo ambientale, ad esempio investimenti in imprese che cercano di soddisfare due criteri:

- 1) seguire le migliori prassi ambientali e sociali
- 2) evitare di produrre beni o prestare servizi che arrechino danni ambientali e sociali.

Per poter affermare che l'impresa beneficiaria degli investimenti contribuisce al predetto obiettivo, deve trattarsi di una società "best performer" nel proprio settore di attività con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. La definizione di "best performer" si basa sull'esclusiva metodologia ESG di Amundi per la misurazione della performance ESG di un'impresa beneficiaria degli investimenti. Per poter essere considerata best performer, un'impresa beneficiaria di investimenti deve ottenere un rating compreso tra i migliori tre (A, B o C su una scala di rating che va da A a G) nel proprio settore con riferimento ad almeno un fattore ambientale o sociale rilevante. I fattori ambientali e sociali rilevanti sono identificati al livello del settore. L'identificazione dei fattori rilevanti si basa sul quadro di analisi ESG di Amundi che combina dati extra-finanziari e analisi qualitativa del settore associato con le tematiche della sostenibilità. I fattori identificati come rilevanti sono quelli da cui risulta un contributo al punteggio ESG complessivo che sia superiore al 10%. Per il settore energetico per esempio i fattori rilevanti sono: emissioni e energia, biodiversità e inquinamento, salute e sicurezza, comunità locali e diritti umani. Per una panoramica più completa, consultare la Politica di investimento responsabile globale di Amundi su <https://about.amundi.com/>.

Inoltre, le imprese beneficiarie degli investimenti non dovrebbero avere un'esposizione significativa verso settori di attività (quali, per esempio, tabacco, armi, gioco d'azzardo, carbone, aviazione, produzione di carni, produzione di fertilizzanti e pesticidi, produzione di plastica monouso). Per una panoramica più completa di settori e fattori, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

La natura sostenibile di un investimento è valutata a livello dell'impresa beneficiaria degli investimenti. Applicando la definizione di Investimento Sostenibile sopra delineata ai componenti dell'Indice in relazione a questo prodotto ETF gestito in modo passivo, Amundi ha stabilito che questo Prodotto ha la quota minima di investimenti sostenibili indicata alla precedente pagina 1. Tuttavia, si noti che la definizione di Investimento Sostenibile adottata da Amundi non è attuata a livello di metodologia dell'Indice.

● **In che modo gli investimenti sostenibili che il prodotto finanziario intende in parte realizzare non arrecano un danno significativo a nessun obiettivo di investimento sostenibile sotto il profilo ambientale o sociale?**

Per garantire che gli investimenti sostenibili non arrechino un danno significativo (principio "non arrecare un danno significativo" o "DNSH"), Amundi si avvale di due filtri:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili (ad es. intensità delle emissioni di gas serra da parte delle imprese beneficiarie degli investimenti) attraverso una combinazione di indicatori (ad es. l'intensità carbonica) e specifiche soglie o regole (ad es. che il livello dell'intensità carbonica dell'impresa beneficiaria degli investimenti non rientri nell'ultimo decile del settore).

I principali effetti negativi sono gli effetti negativi più significativi delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità relativi a problematiche ambientali, sociali e concernenti il personale, il rispetto dei diritti umani e le questioni relative alla lotta

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei principali effetti negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di Amundi per l'Investimento Responsabile. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

Oltre gli specifici indicatori relativi ai fattori di sostenibilità contemplati nel primo filtro, Amundi ha definito un secondo filtro, che non tiene conto degli indicatori obbligatori concernenti i Principali Effetti Negativi sopra descritti, al fine di verificare che la società non abbia una performance negativa da un punto di vista ambientale o sociale complessivo rispetto ad altre aziende del suo stesso settore; ciò corrisponde a un punteggio ambientale o sociale superiore o uguale a E nella scala di rating ESG di Amundi.

– *In che modo si è tenuto conto degli indicatori degli effetti negativi sui fattori di sostenibilità?*

Gli indicatori relativi agli effetti negativi sono stati presi in considerazione come riportato nel primo filtro DNSH, sopra descritto:

Il primo filtro DNSH si basa sul monitoraggio degli indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1, delle RTS quando sono disponibili dati affidabili attraverso la combinazione dei seguenti indicatori e specifiche soglie o regole:

- avere un'intensità di CO2 che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende del medesimo settore (applicabile solo a settori ad alta intensità); e
- avere un grado di diversità nel Consiglio di Amministrazione che non rientri nell'ultimo decile rispetto alle altre aziende nel medesimo settore; e
- non essere implicata in controversie riguardanti le condizioni di lavoro e i diritti umani;
- non essere implicata in controversie riguardanti biodiversità e inquinamento.

Amundi prende attualmente in considerazione alcuni dei Principali Effetti Negativi nell'ambito della propria politica di esclusione, facente parte della Politica di investimento responsabile di Amundi. Tali esclusioni, che si applicano in aggiunta ai test sopra descritti, coprono i seguenti temi: esclusione di armi controverse, violazione di Principi del Global Compact dell'ONU, settore del carbone e del tabacco.

– *In che modo gli investimenti sostenibili sono allineati con le linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e con i Principi guida delle Nazioni Unite su imprese e diritti umani? Descrizione particolareggiata:*

Le Linee guida OCSE destinate alle imprese multinazionali e i Principi Guida ONU su imprese e diritti umani sono integrati nella metodologia di rating ESG di Amundi. Il nostro meccanismo esclusivo di rating valuta gli emittenti servendosi dei dati disponibili provenienti dai nostri fornitori di dati. Per esempio, il modello ha un criterio dedicato denominato "Coinvolgimento della Comunità e Diritti Umani" che viene applicato a tutti i settori oltre ad altri criteri correlati ai diritti umani, tra i quali catene di fornitura socialmente responsabili, condizioni di lavoro e relazioni sindacali. Inoltre, Amundi effettua il monitoraggio delle controversie con frequenza almeno trimestrale includendo aziende identificate per la violazione di diritti umani. Nel caso in cui emerga una controversia, gli analisti stimano la situazione, assegnano un punteggio alla controversia (servendosi della nostra metodologia esclusiva) e stabiliscono il modo migliore di agire. I punteggi relativi alle controversie

vengono aggiornati trimestralmente per tenere traccia dell'andamento e delle misure adottate per porvi rimedio

La tassonomia dell'UE stabilisce il principio "non arrecare un danno significativo", in base al quale gli investimenti allineati alla tassonomia non dovrebbero arrecare un danno significativo agli obiettivi della tassonomia dell'UE, ed è corredata di criteri specifici dell'UE.

Il principio "non arrecare un danno significativo" si applica solo agli investimenti sottostanti il prodotto finanziario che tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili. Gli investimenti sottostanti la parte restante del presente prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.

Nessun altro investimento sostenibile deve arrecare un danno significativo agli obiettivi ambientali o sociali.



Questo prodotto finanziario prende in considerazione i principali effetti negativi sui fattori di sostenibilità?

Sì, il Comparto prende in considerazione i principali effetti negativi di cui all'Allegato 1, Tabella 1 delle RTS applicabili alla strategia del Comparto e si avvale di una combinazione di politiche di esclusione (normative e settoriali) e di approcci di impegno e di voto.

- Esclusione: Amundi ha definito regole di esclusione normative basate sulle attività e sui settori che contemplano alcuni dei principali indicatori di sostenibilità negativi elencati nel Regolamento SFDR. Come specificato nella Politica di investimento responsabile globale di Amundi (<https://about.amundi.com/esg-documentation>), le esclusioni basate sulle attività si riferiscono a emittenti coinvolti nella produzione, nella vendita, nello stoccaggio, o nella fornitura dei relativi servizi, di mine antiuomo e munizioni a grappolo, armi chimiche, biologiche e all'uranio impoverito, armi nucleari o emittenti che commettano violazioni, gravi e reiterate, anche solo di uno dei dieci principi del Global Compact delle Nazioni Unite. Le esclusioni basate sui settori si riferiscono a carbone termico, combustibili fossili non convenzionali e tabacco.

- Impegno: L'impegno è un processo continuo e orientato agli scopi che mira a influenzare le attività o il comportamento delle imprese beneficiarie degli investimenti. Le attività di impegno possono essere avere due finalità: l'impegno di un emittente a migliorare il modo in cui integra la dimensione ambientale e sociale e l'impegno di un emittente a migliorare il suo impatto su problematiche ambientali, sociali e legate ai diritti umani o su altre questioni di sostenibilità che sono rilevanti per la società e per l'economia globale.

- Voto: La politica di voto di Amundi risponde a un'analisi olistica di tutte le questioni a lungo termine che possono influenzare la creazione di valore, comprese le questioni ESG rilevanti. Per ulteriori informazioni, consultare la Politica di Voto di Amundi disponibile su <https://about.amundi.com/esg-documentation>

- Monitoraggio delle controversie: Amundi ha sviluppato un sistema di monitoraggio delle controversie che si avvale dei dati di tre fornitori di dati esterni (MSCI, Sustainalytics e ISS ESG) per tenere traccia sistematicamente delle controversie e del loro livello di gravità. Questo approccio quantitativo viene quindi arricchito da una valutazione approfondita, condotta da analisti ESG, di ciascuna controversia grave nell'ambito di un riesame periodico. Questo approccio viene applicato a tutti i fondi Amundi.

Per indicazioni sull'utilizzo di indicatori obbligatori concernenti i principali effetti negativi, consultare la Dichiarazione SFDR di Amundi su www.amundi.lu <https://about.amundi.com/esg-documentation>

No



Qual è la strategia di investimento seguita da questo prodotto finanziario?

Replicare la performance dell'S&P World Utilities Weighted & Screened Index (l'"Indice"). L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Utilities Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore delle utilities, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società di utilities sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore delle utilities comprende società fornitrici di elettricità, gas e acqua. Include inoltre produttori indipendenti di energia elettrica e trader di energia nonché società operanti nella generazione e distribuzione di energia elettrica da fonti rinnovabili. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

La strategia di investimento guida le decisioni di investimento sulla base di fattori quali gli obiettivi di investimento e la tolleranza al rischio.

● **Quali sono gli elementi vincolanti della strategia di investimento utilizzati per selezionare gli investimenti al fine di rispettare ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse da questo prodotto finanziario?**

Questo prodotto finanziario è un ETF gestito in modo passivo. La sua strategia di investimento consiste nel replicare l'Indice riducendo al minimo il relativo Tracking Error.

L'universo iniziale dell'Indice include tutti i titoli che compongono l'Indice originario. Successivamente, si applicano i filtri seguenti:

1. Esclusione di società coinvolte in settori di attività identificati in conformità alla metodologia pubblicata dell'Indice, tra i quali tabacco, carbone termico, armi controverse, forniture militari, armi di piccolo calibro (small arms), sabbie bituminose, energia da scisto, produzione di elettricità da petrolio e gas artico;
2. Esclusione di società con un punteggio relativo ai principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UNGC Score*) insufficiente per la qualificazione.
3. Esclusione delle società implicate in importanti controversie ESG*, ad esempio riguardanti crimini economici e corruzione, truffa, pratiche commerciali illecite, problematiche relative ai diritti umani, controversie in materia di lavoro, sicurezza sul luogo di lavoro, incidenti catastrofici, disastri ambientali.
4. Esclusione delle società prive di un punteggio S&P Global ESG Score*.
5. Esclusione di società con un punteggio ESG che risulta compreso nel 5% inferiore dell'universo del relativo settore GICS. La valutazione su cui si fonda il punteggio S&P Global ESG Score è incentrata su criteri di sostenibilità rilevanti dal punto di vista finanziario per la performance aziendale, per la valutazione e per la selezione dei titoli.

Dall'universo rimanente vengono selezionati i componenti idonei dell'Indice nel rispetto dei seguenti vincoli di ottimizzazione:

- Riduzione dell'intensità delle emissioni di gas serra di almeno il 30% rispetto all'Indice originario
- Stesso punteggio S&P Global ESG o miglioramento del punteggio S&P Global ESG rispetto all'Indice originario

*Per ulteriori informazioni sul punteggio S&P Global ESG Score, sul punteggio UNGC e sulle controversie ESG, consultare la metodologia dell'Indice disponibile su www.spglobal.com/spdji/.

La strategia del Prodotto si avvale anche di politiche di esclusione sistematiche (normative e settoriali), come descritto più dettagliatamente nella Politica di investimento responsabile di Amundi.

Le prassi di **buona governance** comprendono strutture di gestione solide, relazioni con il personale, remunerazione del personale e rispetto degli obblighi fiscali.

● **Qual è il tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento?**

Non è previsto un tasso minimo impegnato per ridurre la portata degli investimenti considerati prima dell'applicazione di tale strategia di investimento

● **Qual è la politica per la valutazione delle prassi di buona governance delle imprese beneficiarie degli investimenti?**

Amundi fa affidamento sulla metodologia di rating ESG di Amundi. La metodologia di Amundi per l'attribuzione di un punteggio ESG si basa su un quadro di analisi ESG esclusivo, che prevede 38 criteri, sia generali che settoriali specifici, ivi inclusi criteri di governance. Nella dimensione della Governance, Amundi prende in considerazione la capacità dell'emittente di garantire un quadro efficace di governo societario in grado di assicurare il raggiungimento degli obiettivi a lungo termine (ad es. garantendo il valore dell'emittente nel lungo periodo). Sono presi in considerazione i seguenti sotto criteri di governance: struttura del consiglio di amministrazione, audit e controllo, compensi, diritti degli azionisti, etica aziendale, prassi fiscale e strategia ESG. La scala di Rating ESG di Amundi prevede sette gradi di valutazione che vanno da A a G, dove A esprime la migliore valutazione e G la peggiore. Le aziende con Rating di grado G sono escluse dall'universo di investimento.

Ogni titolo aziendale (azioni, obbligazioni, derivati di tipo single-name, ETF di tipo ESG sia azionari che a reddito fisso) incluso in portafogli di investimento è stato valutato alla luce delle prassi di buona governance dell'emittente associato, applicando un filtro normativo basato sui principi del Global Compact delle Nazioni Unite (UN GC). La valutazione avviene su base continuativa. Il Comitato per il rating ESG di Amundi riesamina mensilmente la lista delle aziende che violano i principi dell'UN GC con conseguente declassamento del rating al grado G. Il disinvestimento dai titoli il cui punteggio è stato declassato a G avviene automaticamente entro 90 giorni.

La Politica di Stewardship di Amundi (comprensiva di politiche di impegno e di voto) relativa alla governance integra questo approccio.



Qual è l'allocazione degli attivi programmata per questo prodotto finanziario?

Il 90% dei titoli e degli strumenti del Comparto soddisferà le caratteristiche ambientali o sociali promosse in conformità agli elementi vincolanti della metodologia dell'Indice. Inoltre, il Comparto si impegna ad avere almeno il 10% di Investimenti Sostenibili, in base al grafico seguente.

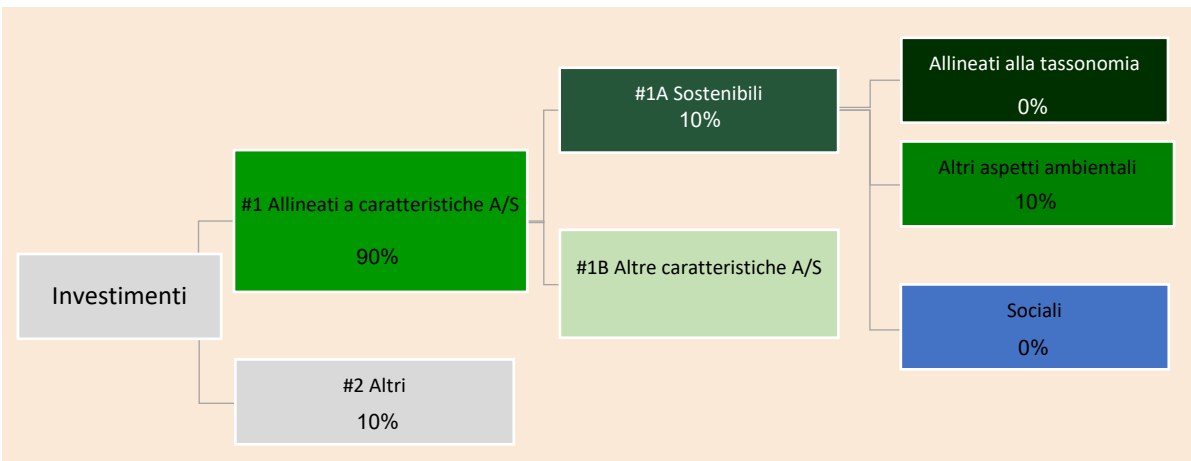
L'**allocazione degli attivi** descrive la quota di investimenti in attivi specifici.

Le attività allineate alla tassonomia sono espresse in percentuale di:

- **fatturato** quota di entrate da attività verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti

- **spese in conto capitale (CapEx):** investimenti verdi effettuati dalle imprese beneficiarie degli investimenti, ad es. per la transizione verso un'economia verde

- **spese operative (OpEx):** attività operative verdi delle imprese beneficiarie degli investimenti.



#1 Allineati a caratteristiche A/S: comprende gli investimenti del prodotto finanziario utilizzati per rispettare le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario.
#2 Altri: comprende gli investimenti rimanenti del prodotto finanziario che non sono allineati alle caratteristiche ambientali o sociali, né sono considerati investimenti sostenibili.

La categoria **#1 Allineati a caratteristiche A/S** comprende:
- la sottocategoria **#1A Sostenibili**, che contempla gli investimenti sostenibili con obiettivi ambientali o sociali.
- la sottocategoria **#1B Altre caratteristiche A/S**, che contempla gli investimenti allineati alle caratteristiche ambientali o sociali che non sono considerati investimenti sostenibili.

● ***In che modo l'utilizzo di strumenti derivati rispetta le caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

Gli strumenti derivati non vengono utilizzati ai fini del rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal Comparto.

🌍 ***In quale misura minima gli investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale sono allineati alla tassonomia dell'UE?***

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE.

Il Comparto attualmente non prevede un impegno minimo a investimenti con un obiettivo ambientale che siano in linea con la Tassonomia dell'UE, inclusi gli investimenti in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare.

● ***Il prodotto finanziario investe in attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE¹⁰?***

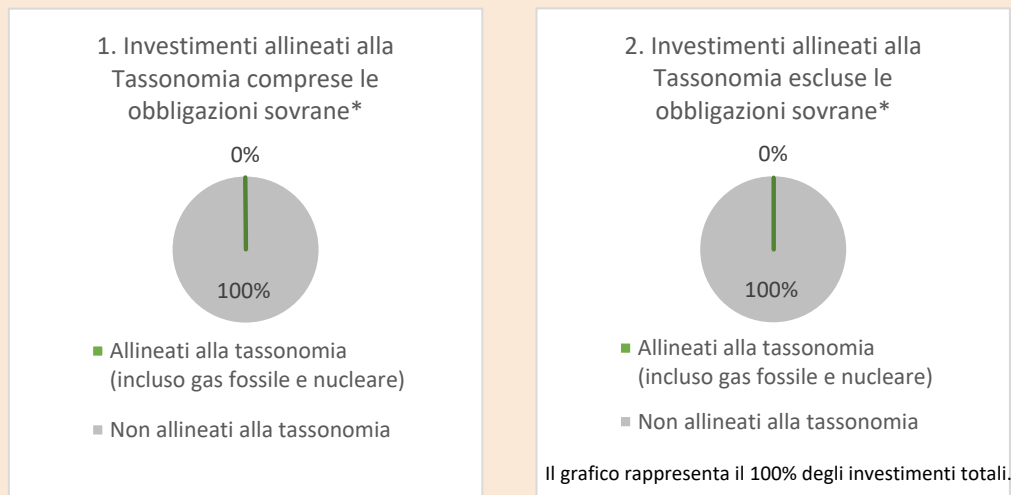
Sì:
 Gas fossile Energia nucleare
 No

¹⁰ Le attività connesse al gas fossile e/o all'energia nucleare sono conformi alla tassonomia dell'UE solo se contribuiscono all'azione di contenimento dei cambiamenti climatici ("mitigazione dei cambiamenti climatici") e non arrecano un danno significativo a nessuno degli obiettivi della tassonomia dell'UE. I criteri completi riguardanti le attività economiche connesse al gas fossile e all'energia nucleare che sono conformi alla tassonomia dell'UE sono stabiliti nel regolamento delegato (UE) 2022/1214 della Commissione.

Le attività abilitanti consentono direttamente ad altre attività di apportare un contributo sostanziale a un obiettivo ambientale.

Le attività di transizione sono attività per le quali non sono ancora disponibili alternative a basse emissioni di carbonio e che presentano, tra gli altri, livelli di emissione di gas a effetto serra corrispondenti alla migliore prestazione.


I due grafici che seguono mostrano in verde la percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia dell'UE. Poiché non esiste una metodologia adeguata per determinare l'allineamento delle obbligazioni sovrane alla tassonomia, il primo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia in relazione a tutti gli investimenti del prodotto finanziario comprese le obbligazioni sovrane, mentre il secondo grafico mostra l'allineamento alla tassonomia solo in relazione agli investimenti del prodotto finanziario diversi dalle obbligazioni sovrane.*



* Ai fini dei grafici di cui sopra, per "obbligazioni sovrane" si intendono tutte le esposizioni sovrane

● **Qual è la quota minima di investimenti in attività di transizione e abilitanti?**

Il fondo non prevede una quota minima di investimenti in attività di transizione o in attività abilitanti.

 sono investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che **non tengono conto dei criteri** per le attività economiche ecosostenibili conformemente alla tassonomia dell'UE.

 **Qual è la quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale che non sono allineati alla tassonomia dell'UE?**

Il Comparto non prevede una quota minima di investimenti sostenibili con un obiettivo ambientale, tuttavia la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 10% in totale

 **Qual è la quota minima di investimenti socialmente sostenibili?**

Sebbene il Comparto non preveda un'allocazione minima di investimenti socialmente sostenibili, la quota di investimenti sostenibili dal punto di vista ambientale e sociale sarà almeno pari al 10% in totale

 **Quali investimenti sono compresi nella categoria «#2 Altri» e qual è il loro scopo? Esistono garanzie minime di salvaguardia ambientale o sociale?**

Sono inclusi in questa categoria la liquidità, i derivati e le società per le quali non è prevista una copertura finanziaria supplementare.



È designato un indice specifico come indice di riferimento per determinare se questo prodotto finanziario è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove?

Sì, l'Indice è stato designato come indice di riferimento per determinare se il Comparto è allineato alle caratteristiche ambientali e/o sociali che promuove.

- ***In che modo l'indice di riferimento è costantemente allineato a ciascuna delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal prodotto finanziario?***

In base ai regolamenti applicabili agli sponsor dell'indice (compreso il Regolamento sugli indici di riferimento), gli sponsor dell'indice devono definire meccanismi di controllo/due diligence appropriati nella definizione e/o applicazione di metodologie di indici regolamentati. Inoltre, in occasione di ogni ribilanciamento dell'indice, il fornitore dell'indice applica i criteri di selezione ESG all'Indice originario per escludere gli emittenti che non soddisfano tali criteri di selezione ESG.

- ***In che modo è garantito l'allineamento su base continuativa della strategia di investimento alla metodologia dell'indice?***

L'obiettivo di investimento del Comparto è replicare la performance dell'Indice.

- ***Per quali aspetti l'indice designato differisce da un indice generale di mercato pertinente?***

L'Indice è un indice azionario che misura la performance di titoli azionari idonei dell'S&P World Utilities Index (l'"Indice originario"). L'Indice originario è ideato per misurare la performance di società a grande e media capitalizzazione del settore delle utilities, attive nei Mercati Sviluppati (secondo la definizione di S&P) che costituiscono circa l'85% del capitale totale disponibile. Le società di utilities sono identificate con riferimento allo standard GICS. Il settore delle utilities comprende società fornitrici di elettricità, gas e acqua. Include inoltre produttori indipendenti di energia elettrica e trader di energia nonché società operanti nella generazione e distribuzione di energia elettrica da fonti rinnovabili. L'Indice è selezionato e ponderato per migliorare gli obiettivi ambientali, sociali e di governance e ridurre l'intensità delle emissioni di carbonio, il tutto rispetto all'Indice originario.

- ***Dove è reperibile la metodologia applicata per il calcolo dell'indice designato?***

Ulteriori informazioni sull'Indice sono disponibili su www.spglobal.com/spdji/

Dove è possibile reperire online maggiori informazioni specifiche sul prodotto?



Maggiori informazioni specifiche sul prodotto sono reperibili sul sito web: Ulteriori informazioni sul Comparto sono disponibili sul sito web www.amundiETF.com.

Esposizione globale e leva finanziaria

La modifica del nome dei Comparti nella tabella nella sezione del Prospetto intitolata "Esposizione globale e leva finanziaria" per riflettere il cambio di nome del Comparto:

Comparto	Metodologia di calcolo dell'esposizione globale	Leva finanziaria
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF	Approccio dell'impegno	100% del NAV

Uso di operazioni di finanziamento tramite titoli e Total Return Swap

La modifica del nome dei Comparti nella tabella riportata nella sezione del Prospetto intitolata "Uso di operazioni di finanziamento tramite titoli e Total Return Swap":

COMPARTI	Pronti contro termine - Attesi (%)	Pronti contro termine - Massimo (%)	Pronti contro termine inversi - Attesi (%)	Pronti contro termine inverso - Massimo (%)	Prestito titoli - Atteso (%)	Prestito titoli - Massimo (%)	Prestito titoli (titoli presi in prestito) - Atteso (%)	Prestito titoli (titoli presi in prestito) - Massimo (%)	TRS - Atteso (%)	TRS - Massimo (%)
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF	0	0	0	0	20%	33,3%	0	0	0	0

Investimento sostenibile

La modifica del nome dei Comparti nella sezione seguente del Prospetto intitolata "Investimento sostenibile".

I Comparti di seguito elencati sono classificati ai sensi dell'articolo 8 del Regolamento sull'informativa e mirano a promuovere caratteristiche ambientali o sociali.

COMPARTI
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF

Legge tedesca sulla tassazione degli investimenti

La modifica del nome dei Comparti nella tabella riportata nella sezione "Legge tedesca sulla tassazione degli investimenti";

COMPARTI	La percentuale di attività lorde investite in azioni (secondo quanto stabilito dalla "InvStG")
Amundi S&P World Consumer Discretionary Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Consumer Staples Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Energy Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Financials Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Health Care Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Industrials Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Information Technology Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Materials Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF	60%
Amundi S&P World Communication Services Screened UCITS ETF	60%