

**Pubblicazioni sul sito web ai sensi dell'art. 10 comma 1 del Regolamento sulla
pubblicazione di informazioni in materia di sostenibilità nel settore dei servizi finanziari
per i prodotti finanziari di cui all'art. 8**

SINTESI

Denominazione del prodotto:

AMUNDI PEA S&P US Industrials Screened
UCITS ETF

ID entità giuridica:

9695009HKFIX2X728481

Senza obiettivo di investimento sostenibile

Questo prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali o sociali, ma non mira a realizzare investimenti sostenibili.

Questo prodotto finanziario si impegna a realizzare investimenti sostenibili.

Caratteristiche ambientali o sociali del Prodotto Finanziario

Il Fondo promuove caratteristiche ambientali e/o sociali attraverso la replica di un indice di riferimento che integra un rating ambientale, sociale e di governance (ESG). Un processo di ottimizzazione determina un punteggio ESG per l'indice S&P 500 Plus Industrials Enhanced Weighted & Screened Index (di seguito denominato "Indice di riferimento" o "Indice") superiore di almeno il 10% a quello dell'Indice originario.

i. Esclusione di società coinvolte nei seguenti settori: armi controverse, contratti militari, carbone termico, tabacco, sabbie bituminose e scisto, gas di scisto, trivellazioni nell'Artico, petrolio e gas nell'Artico, armi leggere, produzione di energia da combustibili fossili

ii. Esclusione di società identificate come operanti in violazione del Global Compact delle Nazioni Unite (in base alla metodologia definita dal fornitore di dati Sustainalytics) o non coperte da Sustainalytics

iii. Esclusione di società per le quali il fornitore di dati Trucost non è in grado di calcolare l'intensità di carbonio

iv. Esclusione di società che non hanno un punteggio S&P Global ESG o il cui punteggio S&P Global ESG rientra nel 5% più basso dell'universo di investimento

v. Esclusione di società che non hanno un punteggio S&P Global ESG Environmental o il cui punteggio S&P Global ESG Environmental rientra nel 5% più basso dell'universo di investimento

vi. Esclusione di società soggette a controversie come determinato da S&P

vii. Processo di ottimizzazione volto a ridurre l'impronta di carbonio rispetto all'Indice originario di almeno il 30% e a migliorare i punteggi ESG di S&P Global di almeno il 10% rispetto all'indice originario

Proporzione degli investimenti

Almeno il 90% dei titoli e degli strumenti dell'OICR è soggetto ad analisi ESG e pertanto è allineato alle caratteristiche ambientali o sociali promosse, in linea con gli elementi vincolanti della strategia di investimento. Inoltre, l'OIC si impegna a detenere almeno l'1% in investimenti sostenibili (sulla base del suo attivo netto), come indicato nella tabella seguente.

Controllo, metodologie, fonti di dati e relativi limiti, due diligence e politiche di coinvolgimento

Tutti i dati ESG, trattati esternamente o internamente, sono centralizzati dalla Linea di business Responsible Investment, che è responsabile del controllo della qualità dei dati ESG elaborati. Questa verifica comprende controlli qualità automatizzati e controlli qualitativi effettuati da analisti ESG specializzati nei rispettivi settori. I rating ESG vengono aggiornati mensilmente nello strumento proprietario di Amundi, il modulo Stock Rating Integrator (SRI).

Gli indicatori di sostenibilità utilizzati in Amundi si basano su metodologie proprietarie. Questi indicatori sono resi disponibili in modo permanente nel sistema di gestione del portafoglio, consentendo ai gestori di valutare l'impatto delle loro decisioni di investimento.

Inoltre, questi indicatori sono integrati nel quadro di controllo di Amundi, con responsabilità suddivise tra controllo di primo livello svolto dagli stessi team di gestione e controllo di secondo livello svolto dai team di rischio, che monitorano costantemente il rispetto delle caratteristiche ambientali o sociali promosse dal fondo.

Il rating ESG di Amundi utilizzato per determinare il punteggio ESG è un rating ESG quantitativo basato su sette punteggi, che vanno da A (migliore) a G (peggiore). Nella scala di rating ESG di Amundi, i titoli appartenenti all'elenco delle esclusioni corrispondono a un rating G. La performance ESG degli emittenti viene valutata globalmente e a livello dei criteri pertinenti rispetto alla performance media del loro settore, combinando le tre dimensioni ESG.

La metodologia applicata nel rating ESG di Amundi utilizza 38 criteri, che possono essere generici (comuni a tutte le aziende, indipendentemente dalla loro attività) o specifici di un settore. I criteri sono ponderati per settore e vengono valutati in base al loro impatto sulla reputazione dell'emittente, sull'efficienza operativa e sulla conformità normativa. I rating ESG di Amundi possono essere espressi a livello globale sulle tre dimensioni E, S e G oppure individualmente su qualsiasi fattore ambientale o sociale.

I rating ESG di Amundi vengono stabiliti utilizzando il sistema di analisi ESG e la metodologia di rating di Amundi. Per le valutazioni ESG, reperiamo i dati dalle seguenti fonti: Moody, ISS-Oekom, MSCI e Sustainalytics.

I nostri limiti metodologici sono per definizione legati all'uso dei dati ESG. Il panorama dei dati ESG è in fase di standardizzazione, il che potrebbe avere un impatto sulla qualità dei dati; anche la copertura dei dati rappresenta un limite. Le normative attuali e future miglioreranno la standardizzazione della rendicontazione e dell'informativa da parte delle società su cui si basano i dati ESG.

Siamo consapevoli di tali limiti, che mitigiamo attraverso una combinazione di approcci.

Ogni mese il rating ESG viene ricalcolato utilizzando la metodologia quantitativa di Amundi. Il risultato di questo calcolo viene poi esaminato dagli analisti ESG che effettuano un "controllo a campione" qualitativo per settore sulla base di diverse verifiche.

Amundi persegue una politica di impegno con gli emittenti in cui investiamo e con quelli in cui potremmo potenzialmente investire, indipendentemente dal tipo di partecipazione detenuta (azioni e obbligazioni).