

Vorvertragliche Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.



Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale

Name des Produkts:
AMUNDI EURO GOVERNMENT TILTED GREEN BOND

Unternehmenskennung (LEI-Code):
54930086L1BR8DOJL973

Ökologische und/ oder soziale Merkmale

Werden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☒ ☒ ☐ Ja

☒ ☐ ☒ X Nein

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: __%

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ Es wird damit ein Mindestanteil an **nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: __%

☒ X Es werden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt werden, enthält es einen Mindestanteil von 25 % an nachhaltigen Investitionen.

☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☒ X mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

☐ mit einem sozialen Ziel

☐ Es werden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.

Welche ökologischen und/oder sozialen Merkmale werden mit diesem Finanzprodukt beworben?

Der Teilfonds bewirbt ökologische und/oder soziale Merkmale unter anderem durch die Nachbildung des Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (der „Referenzwert“), eines Index aus EWU-Staatsanleihen, bei dem die grünen Anleihen im Vergleich zu einem EWU-Staatsanleihen-Standardmarktwert übergewichtet sind.

Der Referenzwert umfasst von EWU-Regierungen begebene Standardanleihen und grüne Anleihen. Die als „grüne Anleihen“ eingestuften Anleihen werden anhand von von Bloomberg bereitgestellten Daten identifiziert.

erreicht werden.

Bei den grünen Anleihen im Index handelt es sich um Anleihen, deren Nettoerlöse vollständig für am Markt anerkannte grüne Aktivitäten gemäß der Klassifizierung von Bloomberg verwendet werden (z. B.: Erneuerbare Energien, Energieeffizienz, grüne Gebäude und andere). Weitere Einzelheiten zu geeigneten Projektkategorien finden Sie unter www.bloomberg.com.

Die grünen Anleihen werden von Bloomberg überprüft, um sicherzustellen, dass sie die Mindestanforderungen für eine angemessene Klassifizierung erfüllen. Die Kriterien entsprechen den Grundsätzen für grüne Anleihen, darunter:

- Verwendung der Erlöse
- Projektauswahlprozess
- Verwaltung der Erlöse
- Berichterstattung

Alle grünen Anleihen werden jährlich überprüft, um sicherzustellen, dass die Erlöse zur Unterstützung grüner Projekte verwendet werden. Anleihen, deren Erlöse nicht innerhalb von 18 Monaten nach der letzten Überprüfung für grüne Zwecke verwendet werden, werden aus dem Index gestrichen. Anleihen, deren Erlöse nachweislich nicht für grüne Zwecke verwendet werden, werden ebenfalls aus dem Index gestrichen.

● ***Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, herangezogen?***

Zur Messung der Erreichung der einzelnen ökologischen und/oder sozialen Merkmale, die durch dieses Finanzprodukt beworben werden, wird der Prozentsatz des Fonds, der Anleihen zugewiesen wird, die von Bloomberg als „grüne Anleihen“ angesehen werden, herangezogen.

Genauer gesagt erfüllt die Methodik des Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (der „Referenzwert“) des Index die folgenden Kriterien:

- Zulässige Anleihen haben ein ausstehendes Volumen von mindestens 300 Mio. EUR und werden von Ländern der Eurozone mit einem Emissionsvolumen von mindestens 50 Mrd. EUR begeben. Die Liste der Länder, die für den Index infrage kommen, wird jährlich überprüft.
- Die Länder müssen ein Investment-Grade-Rating (Baa3/BBB-/BBB-) oder höher aufweisen, um unter Verwendung des mittleren Ratings von Moody's, S&P und Fitch in den Index aufgenommen zu werden.
- Die Laufzeit muss unabhängig von der Optionalität mindestens ein Jahr bis zur Endfälligkeit betragen.
- Kapital und Zinsen müssen auf EUR lauten.
- Der Index wird monatlich neu gewichtet. Vor dem Monatsende wird die Indexzusammensetzung für den Folgemonat auf Basis der Werte des Hauptindex bestimmt, um die Gesamtgewichtung grüner Anleihen („Green Bonds“) auf mindestens 30 % festzulegen und ein mit dem des Hauptindex vergleichbares Risikoprofil beizubehalten.

Darüber hinaus schließt der Index staatliche Emittenten aus, die von Freedom House als „nicht frei“ gekennzeichnet sind.

● ***Welches sind die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?***

Das Ziel der nachhaltigen Anlagen besteht darin, in grüne Anleihen zu investieren, die von

Die **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** sind die bedeutendsten negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte sowie Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Regierungen der EWU begeben werden und die die Kriterien für die Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen sowie die in der Indexmethodik festgelegten Mindestgarantien erfüllen.

● ***Inwiefern werden die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt werden sollen, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele erheblich schaden?***

Um sicherzustellen, dass nachhaltige Anlagen keinen erheblichen Schaden verursachen (DNSH), schließt die Indexmethodik Länder aus, die von Freedom House als „nicht frei“ bezeichnet werden. Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in Wertpapiere, die von staatlichen Emittenten begeben werden, die auf der Sanktionsliste der Europäischen Union (EU) stehen und deren Sanktion aus dem Einfrieren von Vermögenswerten und einem Sanktionsindex auf höchstem Niveau besteht (unter Berücksichtigung der Sanktionen der Vereinigten Staaten und der EU), und zwar nach formeller Überprüfung und Validierung durch den Ratingausschuss von Amundi.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI 15 „THG-Intensität“ wird durch eine Übergewichtung grüner Anleihen im Vergleich zu einem marktgängigen Staatsanleihenindex berücksichtigt. Green Bonds werden ausgegeben, um Projekte gemäß der Methode von Bloomberg zu finanzieren, die positive Umweltauswirkungen haben.

PAI 16 „Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen“ wird durch den Ausschluss von Ländern aus dem Teilfonds berücksichtigt, die auf der Sanktionsliste der Europäischen Union (EU) stehen und deren Sanktion aus dem Einfrieren von Vermögenswerten und einem Sanktionsindex auf höchstem Niveau besteht (unter Berücksichtigung der Sanktionen der Vereinigten Staaten und der EU), und zwar nach formeller Überprüfung und Validierung durch den Ratingausschuss von Amundi. Darüber hinaus schließt der Referenzwert staatliche Emittenten aus, die von Freedom House als „nicht frei“ eingestuft werden.

Wie stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Gilt nicht für staatliche Emittenten.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

- X Ja, PAI 15 „THG-Intensität“ wird durch eine Übergewichtung grüner Anleihen im Vergleich zu einem marktgängigen Staatsanleihenindex berücksichtigt. Green Bonds werden ausgegeben, um Projekte zu finanzieren, die positive Umweltauswirkungen haben.

PAI 16 „Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen“ wird durch den Ausschluss von Ländern aus dem Teilfonds berücksichtigt, die auf der Sanktionsliste der Europäischen Union (EU) stehen und deren Sanktion aus dem Einfrieren von Vermögenswerten und einem Sanktionsindex auf höchstem Niveau besteht (unter Berücksichtigung der Sanktionen der Vereinigten Staaten und der EU), und zwar nach formeller Überprüfung und Validierung durch den Ratingausschuss von Amundi. Darüber hinaus schließt der Referenzwert staatliche Emittenten aus, die von Freedom House als „nicht frei“ eingestuft werden.

Nein



Die Anlagestrategie

dient als Richtschnur für Investitionsentscheidungen, wobei bestimmte Kriterien wie beispielsweise Investitionsziele oder Risikotoleranz berücksichtigt werden.

Die Verfahrensweisen einer guten

Unternehmensführung

umfassen solide Managementstrukturen, die Beziehungen zu den Arbeitnehmern, die Vergütung von Mitarbeitern sowie die Einhaltung der Steuervorschriften.

Welche Anlagestrategie wird mit diesem Finanzprodukt verfolgt?

Der Teilfonds bildet die Wertentwicklung des Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (der „Referenzwert“) nach und minimiert den Tracking Error zwischen dem Nettoinventarwert des Teilfonds und der Wertentwicklung des Index.

Der Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index basiert auf dem Euro Treasury 50bn Bond Index (der „Hauptindex“) und misst die Wertentwicklung von auf Euro lautenden festverzinslichen Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating. Der Index ist so ausgerichtet, dass an einem Neugewichtungstag mindestens 30 % des Marktwerts des Index auf Wertpapiere entfallen, die als grüne Anleihen eingestuft sind, und der verbleibende Prozentsatz auf nicht-grüne Anleihen, und die Risikoprofile des Index und des Hauptindex vergleichbar sind.

Worin bestehen die verbindlichen Elemente der Anlagestrategie, die für die Auswahl der Investitionen zur Erfüllung der beworbenen ökologischen oder sozialen Ziele verwendet werden?

Dies ist ein passiv verwalteter ETF. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Referenzwert nachzubilden und gleichzeitig den entsprechenden Tracking Error zu minimieren.

Genauer gesagt erfüllt der Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index (der „Referenzwert“) die folgenden Kriterien:

- Zulässige Anleihen haben ein ausstehendes Volumen von mindestens 300 Mio. EUR und werden von Ländern der Eurozone mit einem Emissionsvolumen von mindestens 50 Mrd. EUR begeben. Die Liste der Länder, die für den Index infrage kommen, wird jährlich überprüft.

- Die Länder müssen ein Investment-Grade-Rating (Baa3/BBB-/BBB-) oder höher aufweisen, um unter Verwendung des mittleren Ratings von Moody's, S&P und Fitch in den Index aufgenommen zu werden.

- Die Laufzeit muss unabhängig von der Optionalität mindestens ein Jahr bis zur Endfälligkeit betragen.

- Kapital und Zinsen müssen auf EUR lauten.

- Der Index wird monatlich neu gewichtet. Vor dem Monatsende wird die Indexzusammensetzung für den Folgemonat auf Basis der Werte des Hauptindex bestimmt, um die Gesamtgewichtung grüner Anleihen („Green Bonds“) auf mindestens 30 % festzulegen und ein mit dem des Hauptindex vergleichbares Risikoprofil beizubehalten.

Die Produktstrategie stützt sich auch auf eine systematische Ausschlusspolitik (normativ und sektorspezifisch), wie detaillierter in der verantwortungsvollen Anlagepolitik von Amundi beschrieben.

Um welchen Mindestsatz wird der Umfang der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie

in Betracht gezogenen Investitionen reduziert?

Es gibt keinen festgelegten Mindestdatz für die Reduzierung des Umfangs der vor der Anwendung dieser Anlagestrategie in Betracht gezogenen Investitionen.

● *Welche Nachhaltigkeitsindikatoren werden zur Messung der Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels dieses Finanzprodukts herangezogen?*

Gilt nicht für staatliche Emittenten.



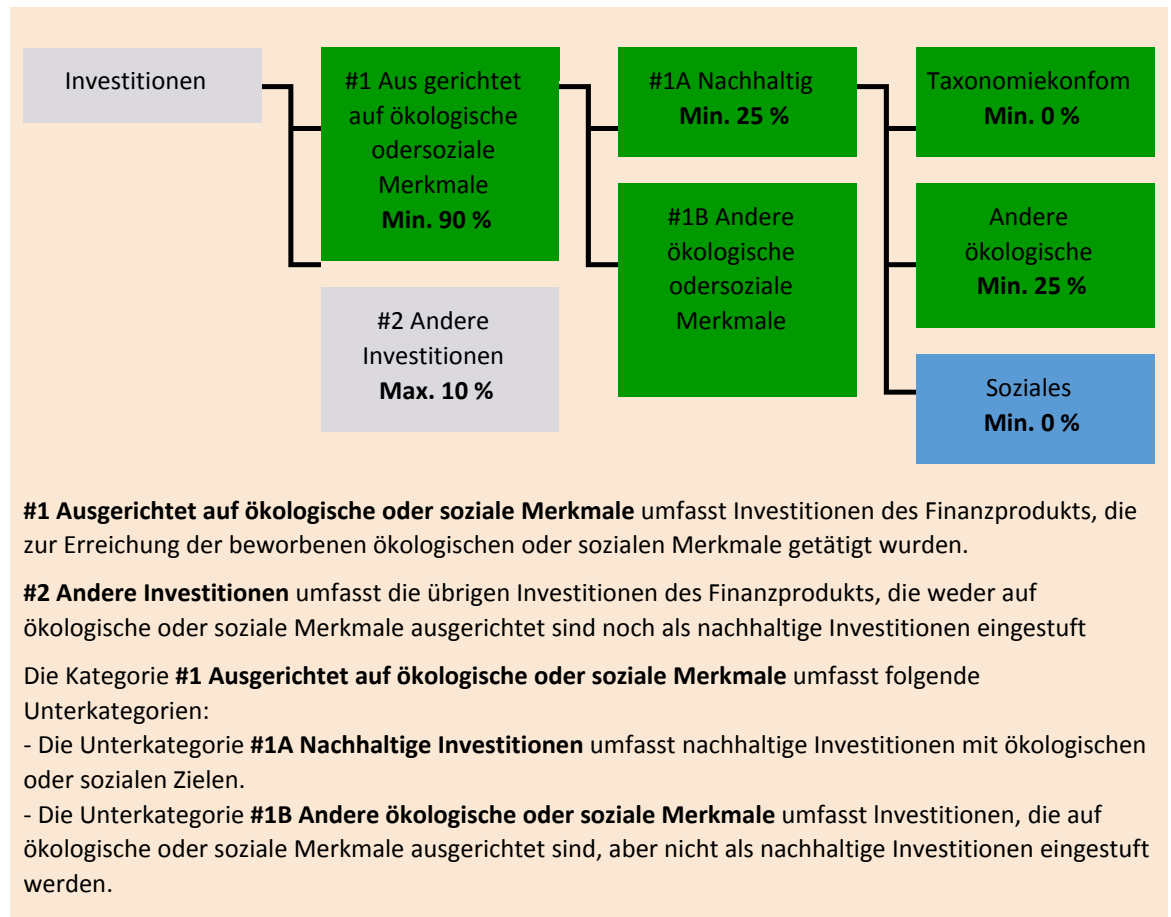
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten werden ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

Welche Vermögensallokation ist für dieses Finanzprodukt geplant?

Mindestens 90 % der Wertpapiere und Instrumente des Teilfonds erfüllen die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale gemäß den verbindlichen Elementen der Indexmethode. Darüber hinaus verpflichtet sich der Teilfonds, einen Mindestanteil von 25 % an nachhaltigen Investitionen gemäß der nachstehenden Tabelle zu halten. Investitionen, die auf andere ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind (#1B), stellen die Differenz zwischen dem tatsächlichen Anteil der Investitionen, die an ökologischen oder sozialen Merkmalen ausgerichtet sind (#1), und dem tatsächlichen Anteil nachhaltiger Investitionen (#1A) dar.



● *Inwiefern werden durch den Einsatz von Derivaten die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht?*

Derivate werden nicht eingesetzt, um die vom Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen.

Ermöglichende

Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten

sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



In welchem Mindestmaß sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

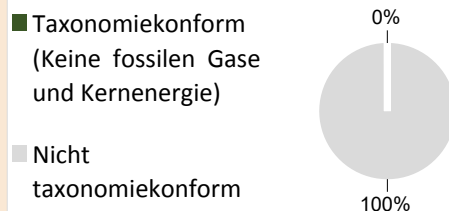
Der Teilfonds verpflichtet sich derzeit nicht zu einem Mindestanteil an Investitionen mit einem Umweltziel, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Der Teilfonds verpflichtet sich nicht zu taxonomiekonformen Investitionen in den Bereichen fossiles Gas und/oder Kernenergie, wie unten dargestellt. Dennoch kann er im Rahmen seiner Anlagestrategie in Unternehmen investieren, die ebenfalls in diesen Branchen tätig sind. Diese Investitionen können taxonomiekonform sein oder auch nicht.

Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

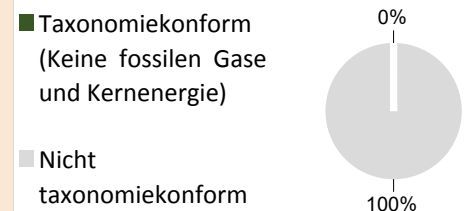
- ☐ Ja:
- ☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomie-Konformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen *



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen *



Diese Grafik gibt 0 % der Gesamtinvestitionen wieder.**

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

** Dieser Prozentsatz ist rein indikativ und kann variieren.

Wie hoch ist der Mindestanteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Die Fonds haben keinen Mindestanteil an Investitionen in Übergangs- oder ermöglichenden Tätigkeiten.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch ist der Mindestanteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie konform sind?

Der Teilfonds hat eine Mindestverpflichtung von 25 % nachhaltiger Investitionen mit einem in diesem Anhang angegebenen Umweltziel, ohne Verpflichtung zu deren Übereinstimmung mit der EU-Taxonomie.



Wie hoch ist der Mindestanteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Teilfonds hat keinen Mindestanteil an sozial nachhaltigen Investitionen.



Welche Investitionen fallen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wird mit ihnen verfolgt und gibt es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Unter „#2 Andere Investitionen“ sind Barmittel und Instrumente für die Zwecke des Liquiditäts- und Portfoliorisikomanagements enthalten.



Referenzwerte sind Indizes, mit denen gemessen wird, ob die Finanzprodukte die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreichen.

Wurde ein Index als Referenzwert bestimmt, um festzustellen, ob dieses Finanzprodukt auf die beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist?

Ja, der Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index wurde als Referenzwert festgelegt, um festzustellen, ob der Teilfonds auf die von ihm beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet ist.

● **Inwiefern ist der Referenzwert kontinuierlich auf die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet?**

Gemäß den für Index-Sponsoren geltenden Vorschriften (einschließlich BMR) müssen Index-Sponsoren bei der Definition und/oder Anwendung von Indexmethoden für regulierte Indizes angemessene Kontrollen/Sorgfaltspflichten definieren.

● **Wie wird die kontinuierliche Ausrichtung der Anlagestrategie auf die Indexmethode sichergestellt?**

Das Anlageziel des Teilfonds besteht darin, die Aufwärts- und Abwärtsentwicklung des Index nachzubilden und gleichzeitig die Differenz zwischen der Rendite des Teilfonds und der Rendite des Index zu minimieren.

● **Wie unterscheidet sich der bestimmte Index von einem relevanten breiten Marktindex?**

Der Index basiert auf einem Universum von EWU-Staatsanleihen mit Standardmarktwerten und geänderten Gewichtungen, um grüne Anleihen überzugewichten. Daher wird die Performance nicht mit der des Hauptindex übereinstimmen.

Genauer gesagt basiert der Bloomberg Euro Treasury Green Bond Tilted Index auf dem Euro Treasury 50bn Bond Index (der „Hauptindex“) und misst die Wertentwicklung von auf Euro lautenden festverzinslichen Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating. Der Index ist so ausgerichtet, dass an einem Neugewichtungstag mindestens 30 % des Marktwerts des Index auf Wertpapiere entfallen, die als grüne Anleihen eingestuft sind, und der verbleibende Prozentsatz auf nicht-grüne Anleihen, und die Risikoprofile des Index und des Hauptindex vergleichbar sind.

● **Wo kann die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes eingesehen werden?**

Weitere Informationen zum Index sind unter <https://www.bloomberg.com/professional/product/indices/bloomberg-fixed-income-indices/#/ucits>

verfügbar



Wo kann ich im Internet weitere produktspezifische Informationen finden?

Weitere Informationen zum Teilfonds sind unter www.amundi-etf.com verfügbar.

Haftungsausschluss

15/10/2024.