

Publicación en el sitio web de información relativa a los productos financieros en virtud del art. 10(1) del Reglamento sobre Transparencia en materia de Finanzas Sostenibles para subfondos del art. 8 subfondos:

RESUMEN

Nombre del producto:

AMUNDI S&P 500 SCREENED UCITS ETF

Identificador de entidad jurídica:

2138007NOUJ46G9POA93

Sin objetivo de inversión sostenible

Este producto financiero promueve características medioambientales o sociales, pero no tiene como objetivo una inversión sostenible

Este producto financiero se compromete a realizar inversiones sostenibles.

Características medioambientales o sociales del producto financiero

El Subfondo pretende promover las siguientes características medioambientales y sociales:

- 1) reducción de la producción de armas controvertidas y nucleares; y
- 2) reducción del daño medioambiental derivado de la explotación de las actividades comerciales asociadas a las arenas bituminosas, al carbón térmico y al petróleo y gas no convencionales.

El Subfondo promueve estas características medioambientales y sociales a través de la replicación del S&P 500 Scored & Screened+ Index (USD) NTR (el «Índice»), que integra una calificación medioambiental, social y de gobierno corporativo («ESG»). El Índice se selecciona y pondera con el objetivo de mejorar su sostenibilidad medioambiental y social mediante la aplicación de una serie de filtros medioambientales y sociales a los componentes del S&P 500 Index (el «Índice matriz») para cumplir los objetivos medioambientales en comparación con el Índice matriz, tal como se describe de forma más detallada a continuación.

El Índice se basa en el enfoque «Best-in-class» (el mejor de su categoría): se seleccionan las empresas con la mejor calificación de cada sector para conformar el Índice.

«Best-in-class» es un enfoque en el que se seleccionan inversiones líderes o con la mayor rentabilidad dentro de un universo, sector industrial o clase. Mediante el uso de este enfoque Best-in-class, el Subfondo sigue un enfoque extrafinanciero significativamente atractivo que permite la reducción en al menos un 20 % del universo de inversión inicial (expresado en número de emisores).

Proporción de inversiones

El 90 % de los valores e instrumentos del Subfondo cumplirán las características medioambientales o sociales promovidas de acuerdo con los elementos vinculantes de la metodología del Índice.

Además, el Subfondo se compromete a mantener un mínimo del 15 % en Inversiones Sostenibles, según lo indicado en la siguiente tabla.

Seguimiento, métodos, fuentes de datos y sus limitaciones, diligencia debida y políticas de implicación

Todos los datos ESG, ya sean procesados externa o internamente, están centralizados por la línea de negocio de Inversiones Responsable, que es la responsable de controlar la calidad de la información recibida y de los resultados ESG procesados. Esta supervisión incluye un control de calidad automatizado, así como un control cualitativo realizado por analistas ESG especializados en sus sectores. Las puntuaciones ESG se actualizan mensualmente en el módulo Stock Rating Integrator (SRI) de la herramienta patentada de Amundi.

Los indicadores de sostenibilidad utilizados en Amundi se basan en metodologías propias. Estos indicadores están continuamente disponibles en el sistema de gestión de carteras, lo que permite a los gestores de carteras evaluar el impacto de sus decisiones de inversión.

Además, estos indicadores están integrados en el marco de control de Amundi, con una distribución de responsabilidades entre el primer nivel de controles llevados a cabo por los propios equipos de inversión y el segundo nivel de controles llevados a cabo por los equipos de riesgo, que supervisan el cumplimiento de las características medioambientales o sociales promovidas por el fondo de forma continua.

La calificación ESG de Amundi utilizada para determinar la puntuación ESG es una puntuación cuantitativa ESG traducida a siete niveles, que van de A (el universo de las mejores puntuaciones) a G (las peores puntuaciones). En la escala de calificación ESG de Amundi, los valores que pertenecen a la lista de exclusión se corresponden con una G. Para los emisores corporativos, la rentabilidad ESG se evalúa a nivel global y a nivel de criterios relevantes comparándola con la rentabilidad media de su sector mediante la combinación de las tres dimensiones ESG.

La metodología aplicada por la calificación ESG de Amundi utiliza 38 criterios, que pueden ser genéricos (comunes a todas las empresas, independientemente de su actividad) o específicos para cada sector, ponderados en función del sector y considerados en términos de su impacto en la reputación, la eficiencia operativa y las normativas en relación con un emisor. Es probable que las calificaciones ESG de Amundi se expresen globalmente en las tres dimensiones E, S y G, o de forma individual en cualquier factor medioambiental o social.

Las puntuaciones ESG de Amundi se generan utilizando el marco de análisis ESG y la metodología de puntuación de Amundi. Obtenemos datos de las siguientes fuentes de puntuaciones ESG: Moody, ISS-Oekom, MSCI y Sustainalytics.

Las limitaciones de nuestra metodología están vinculadas por construcción al uso de datos ESG. El panorama de datos ESG se está estandarizando actualmente, lo que puede afectar a la calidad de los

datos; la cobertura de datos también supone una limitación. La normativa actual y futura mejorará los informes estandarizados y las divulgaciones corporativas en las que se basan los datos ESG.

Somos conscientes de estas limitaciones que mitigamos mediante una combinación de enfoques.

Cada mes, la puntuación ESG se vuelve a calcular de acuerdo con la metodología cuantitativa de Amundi. A continuación, los analistas ESG revisan el resultado de este cálculo y llevan a cabo un «control mediante muestreo» cualitativo de su sector basado en varias comprobaciones.

Amundi se implica en las empresas en las que invierte o en empresas en las que puede invertir en el nivel de emisor, independientemente del tipo de participaciones en cartera (renta variable y bonos).