

**Publications sur le site web en vertu de l'art. 10 paragraphe 1 du Règlement  
sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur  
des services financiers pour les compartiments de l'art. 8**

**SYNTHÈSE**

**Dénomination du produit :**  
Amundi S&P World Utilities Screened UCITS ETF

**Identifiant d'entité juridique :**  
213800Y8Q2JPGGCV3738

### Sans objectif d'investissement durable

Ce produit financier promeut des caractéristiques environnementales ou sociales, mais n'a pas pour objectif l'investissement durable.

Ce produit financier s'engage à réaliser des investissements durables.

### Caractéristiques environnementales ou sociales du Produit financier

Le Compartiment vise à promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales suivantes :

- 1) réduction de l'intensité des émissions de carbone ; et
- 2) réduction de la production des armes controversées et nucléaires ; et
- 3) réduction des dommages environnementaux dus aux sables bitumineux, au charbon thermique et aux activités non conventionnelles du secteur pétrolier et gazier.

Le Compartiment promeut ces caractéristiques environnementales et sociales en répliquant le S&P World Utilities Weighted & Screened Index (l'« Indice »), qui intègre une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »). L'Indice est sélectionné et pondéré en appliquant une série de filtres environnementaux et sociaux aux composantes du S&P World Utilities Index (l'« Indice parent ») afin d'améliorer les profils ESG et de réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice parent, comme décrit en détail ci-dessous.

La méthodologie de l'Indice est construite selon une approche inclinée :

- la pondération des entreprises les mieux classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée positivement
- la pondération des sociétés les moins bien classées sur la base de leur notation ESG sera inclinée négativement.

## Proportion d'investissements

Au moins 90 % des titres et instruments du Compartiment répondront aux caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la méthodologie de l'Indice.

En outre, le Compartiment s'engage à avoir un minimum de 10 % d'investissements durables conformément au tableau ci-dessous.

## Contrôle, méthodologies, sources des données et leurs limites, diligence raisonnable et politiques d'engagement

Toutes les données ESG, qu'elles soient traitées en externe ou en interne, sont centralisées par la Ligne Métier Responsable Investment, qui est responsable du contrôle de la qualité des données ESG traitées. Ce contrôle comprend des vérifications qualité automatisées ainsi que des vérifications qualitatives réalisées par des analystes ESG spécialistes de leurs secteurs. Les notes ESG sont mises à jour sur une base mensuelle dans l'outil propriétaire d'Amundi, le module Stock Rating Integrator (SRI).

Les indicateurs de durabilité utilisés au sein d'Amundi reposent sur des méthodologies propriétaires. Ces indicateurs sont mis à disposition en permanence dans le système de gestion de portefeuille permettant aux gérants d'évaluer l'impact de leurs décisions d'investissement.

De plus, ces indicateurs sont intégrés dans le cadre de contrôle d'Amundi, avec des responsabilités réparties entre le contrôle de premier niveau effectué par les équipes de gestion elles-mêmes et le contrôle de second niveau effectué par les équipes de Risques, qui surveillent en permanence le respect des caractéristiques environnementales ou sociales promues par le fonds.

La notation ESG d'Amundi utilisée pour déterminer la note ESG est une note ESG quantitative basée sur sept notations, allant de A (la meilleure) à G (la moins bonne). Dans l'échelle de notation ESG d'Amundi, les titres appartenant à la liste d'exclusion correspondent à une note G. La performance ESG des émetteurs est évaluée globalement et au niveau des critères pertinents par rapport à la performance moyenne de leur secteur, en combinant les trois dimensions ESG.

La méthodologie appliquée lors de la notation ESG d'Amundi fait appel à 38 critères, qui peuvent être génériques (communs à toutes les sociétés quelle que soit leur activité) ou être spécifiques à un secteur. Les critères sont pondérés par secteur, et leur impact sur la réputation, l'efficacité opérationnelle et la conformité réglementaire de l'émetteur est pris en compte. Les notations ESG d'Amundi sont susceptibles d'être exprimées globalement sur les trois dimensions E, S et G ou individuellement sur tout facteur environnemental ou social.

Les notes ESG d'Amundi sont établies à l'aide du cadre d'analyse ESG et de la méthodologie de notation d'Amundi. Pour les notes ESG, nous nous procurons des données à partir des sources suivantes : Moody, ISS-Oekom, MSCI et Sustainalytics.

Nos limites méthodologiques sont par construction liées à l'utilisation des données ESG. Le paysage des données ESG est en cours de normalisation, ce qui peut avoir un impact sur la qualité des données ; la couverture des données constitue également une limite. La réglementation actuelle et future

améliorera la normalisation des rapports et les publications d'informations par les entreprises sur lesquels s'appuient les données ESG.

Nous sommes conscients de ces limites, que nous atténuons par une combinaison d'approches.

Chaque mois, la note ESG est recalculée selon la méthodologie quantitative d'Amundi. Le résultat de ce calcul est ensuite examiné par les analystes ESG qui effectuent un « contrôle par échantillonnage » qualitatif par secteur sur la base de différentes vérifications.

Amundi mène une politique d'engagement auprès des émetteurs dans lesquels nous sommes investis et ceux sur lesquels nous pourrions potentiellement investir, quel que soit le type de participation détenue (actions et obligations).