

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 produits financiers relevant de l'article 8

SYNTHÈSE

Dénomination du produit :

AMUNDI PEA S&P US Industrials Screened UCITS ETF

Identifiant d'entité juridique :

9695009HKFIX2X728481

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 Fonds fait la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales au travers de la réplique d'un indicateur de référence intégrant une notation environnementale, sociale et de gouvernance (ESG). Un processus d'optimisation permet d'avoir un score ESG de l'indice S&P 500 Plus Industrials Enhanced Weighted & Screened Index (ci-après « l'indicateur de référence » ou l'« Indice ») supérieur d'au moins 10% par rapport à l'Indice Parent.

- i. Exclusion de sociétés notamment impliquées dans les secteurs d'activités suivants : armes controversées, contrats militaires, charbon thermique, tabac, sables et schiste bitumineux, gaz de schiste, forage arctique, pétrole et gaz arctiques, armes légères, production d'énergie à partir de combustibles fossiles
- ii. Exclusion de sociétés identifiées comme en violation du Pacte mondial des Nations Unies (à partir de la méthodologie définie par le fournisseur de données Sustainalytics) ou non couvertes par Sustainalytics
- iii. Exclusion de sociétés pour lesquelles le fournisseur de données Trucost n'est pas en mesure de calculer l'intensité carbone
- iv. Exclusion de sociétés qui n'ont pas de score S&P Global ESG ou dont le score S&P Global ESG fait partie des 5% les plus bas parmi l'Univers d'investissement
- v. Exclusion de sociétés qui n'ont pas de score S&P Global ESG environnemental ou dont le score S&P Global ESG environnemental fait partie des 5% les plus bas parmi l'Univers d'investissement

vi. Exclusion de sociétés sujettes à controverses telles que déterminées par S&P

vii. Processus d'optimisation visant à réduire l'empreinte carbone par rapport à l'Indice Parent de 30% minimum et à améliorer les scores S&P Global ESG d'au moins 10 % par rapport à l'Indice Parent

Proportion d'investissements

Au moins 90% des titres et instruments de l'OPC font l'objet d'une analyse ESG et sont donc alignés avec les caractéristiques environnementales ou sociales promues, conformément aux éléments contraignants de la stratégie d'investissement. En outre, l'OPC s'engage à détenir un minimum de 1% d'investissements durables (sur la base de son actif net), comme indiqué dans le 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 Responsible 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 notes, 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 de 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).