Productinformatie op de website volgens art. 10(1) van de Verordening betreffende informatieverschaffing over duurzaamheid in de financiëledienstensector voor art. 8 financiële producten

SAMENVATTING

Productnaam:
AMUNDI INDEX EURO CORPORATE SRI 0-3 Y

Identificatiecode juridische entiteiten (LEI):
5493003U13Y6UYB5XW65

Geen duurzame beleggingsdoelstelling

Dit financiële product promoot ecologische of sociale kenmerken, maar heeft geen duurzame beleggingsdoelstelling.

Dit financiële product verbindt zich ertoe duurzame beleggingen te verrichten.

Ecologische of sociale kenmerken van het financiële product

Het Subfonds promoot ecologische en/of sociale kenmerken door onder andere een Index te repliceren die een ecologische, sociale en governancescore ('ESG') integreert. De Indexmethodologie is samengesteld op basis van een 'best-in-class' benadering: ondernemingen met de beste rangschikking worden geselecteerd om de Index samen te stellen. 'Best-in-class' is een benadering waarbij toonaangevende of best presterende beleggingen worden geselecteerd binnen een universum, sector of klasse. Met behulp van een dergelijke 'best-in-class' benadering volgt de Index een niet-financiële benadering gebaseerd op een significante betrokkenheid die het mogelijk maakt het initiële beleggingsuniversum (uitgedrukt in aantal emittenten) met ten minste 20% te verminderen. Het Subfonds promoot ecologische en/of sociale kenmerken door onder andere een Index te repliceren die een ecologische, sociale en governancescore ('ESG') integreert. De Indexmethodologie is samengesteld op basis van een 'best-in-class' benadering: ondernemingen met de beste rangschikking worden geselecteerd om de Index samen te stellen. 'Best-in-class' is een benadering waarbij toonaangevende of best presterende beleggingen worden geselecteerd binnen een universum, sector of klasse. Met behulp van een dergelijke 'best-in-class' benadering volgt de Index een niet-financiële benadering gebaseerd op een significante betrokkenheid die het mogelijk maakt het initiële beleggingsuniversum (uitgedrukt in aantal emittenten) met ten minste 20% te verminderen.

Aandeel beleggingen

Ten minste 90% van de effecten en instrumenten van het Subfonds zal voldoen aan de ecologische of sociale kenmerken die worden gepromoot in overeenstemming met de bindende elementen van de Indexmethodologie. Voorts verbindt het Subfonds zich ertoe om minstens 20% duurzame beleggingen te hebben, zoals aangegeven in het onderstaande diagram. Beleggingen die zijn afgestemd op overige E/S-kenmerken (#1B) vertegenwoordigen het verschil tussen het werkelijke aandeel van beleggingen dat is afgestemd op ecologische of sociale kenmerken (#1) en het werkelijke aandeel van duurzame beleggingen (#1A). Het geplande aandeel van de andere ecologische beleggingen bedraagt minimaal 20% (i) en kan veranderen naarmate de werkelijke aandelen van op taxonomie afgestemde en/of sociale beleggingen toenemen.

Monitoring, methodologieën, databronnen en hun beperkingen, due diligence en engagementbeleid

Alle ESG-data, extern of intern verwerkt, worden gecentraliseerd door de business line Responsible Investment die verantwoordelijk is voor het controleren van de kwaliteit van de inputs en verwerkte ESG-outputs. Deze monitoring omvat een geautomatiseerde kwaliteitstest en een kwalitatieve controle door ESG-analisten die specialisten zijn in hun sectoren. De ESG-scores worden maandelijks bijgewerkt in de eigen ratingtool van Amundi (SRI-module: Stock Rating Integrator).

Duurzaamheidsindicatoren die binnen Amundi worden gebruikt, zijn gebaseerd op eigen methodologieën. Deze indicatoren worden voortdurend beschikbaar gesteld in het portefeuillebeheersysteem, zodat de portefeuillebeheerders de impact van hun beleggingsbeslissingen kunnen beoordelen.

Bovendien zijn deze indicatoren ingebed in het controlekader van Amundi, met verantwoordelijkheden die zijn verdeeld tussen het eerste niveau van controles die door de beleggingsteams zelf worden uitgevoerd en het tweede niveau van controles die worden uitgevoerd door de Risk-teams die voortdurend toezien op de naleving van de ecologische of sociale kenmerken die door het fonds worden gepromoot.

De ESG-rating van Amundi, die wordt gebruikt om de ESG-score te bepalen, is een kwantitatieve ESG-score die wordt vertaald in zeven klassen, gaande van A (de beste ratings in het universum) tot G (de slechtste). In de ESG-ratingschaal van Amundi komen effecten die tot de uitsluitingslijst behoren overeen met een score G. Voor bedrijfsemittenten worden de ESG-prestaties wereldwijd en op het relevante criterianiveau beoordeeld door vergelijking met de gemiddelde prestaties van de sector voor de combinatie van de drie ESG-dimensies.

De methodologie die door de ESG-rating van Amundi wordt toegepast, maakt gebruik van 38 criteria. Het kan hierbij gaan om algemene criteria (die voor alle ondernemingen gelden, ongeacht hun activiteit) of om sectorspecifieke criteria die per sector worden gewogen en worden beoordeeld op basis van hun impact op de reputatie, de operationele efficiëntie en de regelgeving met betrekking tot een emittent. De ESG-ratings van Amundi worden naar alle waarschijnlijkheid wereldwijd uitgedrukt in de drie dimensies E, S en G of afzonderlijk in een ecologische of sociale factor.

De ESG-scores van Amundi zijn gebaseerd op het ESG-analysekader en de scoremethodologie van Amundi. We halen data uit de volgende bronnen voor ESG-scores: Moody, ISS-Oekem, MSCI en Sustainalytics.

Onze methodologische beperkingen zijn door de opbouw ervan gekoppeld aan het gebruik van ESG-data. Het ESG-datalandschap wordt momenteel gestandaardiseerd, wat van invloed kan zijn op de kwaliteit van de data; de datadekking is ook een beperking. De huidige en toekomstige regelgeving zal de gestandaardiseerde rapportage en informatieverschaffing door ondernemingen waarop ESG-data gebaseerd zijn, verbeteren.

We zijn ons bewust van deze beperkingen die we verzachten door een combinatie van benaderingen.

Elke maand wordt de ESG-score herberekend volgens de kwantitatieve methodologie van Amundi. Het resultaat van deze berekening wordt vervolgens bekeken door de ESG-analisten die op basis van verschillende controles een kwalitatieve 'steekproefcontrole' uitvoeren op hun sector.

Amundi betrekt ondernemingen waarin is belegd of potentieel zal worden belegd op het niveau van de emittent, ongeacht het type effecten dat ze aanhouden (aandelen en obligaties).