

Informatieverschaffing over producten op websites volgens artikel 10(1) van de Verordening betreffende informatieverschaffing over duurzaamheid in de financiële dienstensector voor subfondsen die onder art. 8 vallen

SAMENVATTING

Productbenaming: Lyxor MSCI New Energy ESG Filtered (DR) UCITS ETF

Identificatiecode voor juridische entiteiten (LEI): 9695008U0BHDZBWYFV02

Geen duurzame beleggingsdoelstelling

Dit financiële product promoot ecologische en/of sociale kenmerken maar beoogt geen duurzame beleggingen.

Ecologische of sociale kenmerken van het financiële product

Het financiële product promoot ecologische en/of sociale kenmerken door de replicatie van een Referentiebenchmark met een rating op het gebied van milieu, maatschappij en governance ('ESG').

De Referentiebenchmark is samengesteld op basis van een best-in-classbenadering, d.w.z. dat de ondernemingen met de hoogste ESG-scores in elke sector (overeenkomstig de Global Industry Standard Classification (GICS)) worden geselecteerd om de Referentiebenchmark op te bouwen.

De best-in-classbenadering streeft ernaar de voorkeur te geven aan de best presterende ondernemingen in een universum, een sector of een klasse. Met deze best-in-classfilter volgt het Subfonds een niet-financiële benadering die het mogelijk maakt om de omvang van het beleggingsuniversum (in aantal emittenten) met minstens 20% te verminderen.

Aandeel beleggingen

Ten minste 90% van de effecten en instrumenten van de ICB worden onderworpen aan een ESG-analyse en zijn daarom afgestemd op de ecologische of sociale kenmerken die worden gepromoot, in overeenstemming met de bindende elementen van de beleggingsstrategie. Bovendien verbindt de ICB zich ertoe om minstens 10% duurzame beleggingen aan te houden, zoals aangegeven in de onderstaande tabel.

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

Alle niet-financiële gegevens, zowel externe als interne, worden gecentraliseerd door de Metierlijn Verantwoord Beleggen die belast is met de controle op de kwaliteit van de ontvangen gegevens en de verspreiding ervan. Deze controle omvat een geautomatiseerde kwaliteitscontrole en een kwalitatieve controle door gespecialiseerde ESG-analisten uit hun sector. De ESG-scores worden maandelijks bijgewerkt in de eigen ratingtool van Amundi (SRI-module: Stock Rating Integrator).

De duurzaamheidsindicatoren die Amundi gebruikt, zijn gebaseerd op eigen methodologieën. Deze indicatoren zijn permanent beschikbaar in het portefeuillebeheerssysteem, waardoor de beheerders de impact van hun beleggingsbeslissingen kunnen beoordelen.

Bovendien zijn deze indicatoren opgenomen in het controleproces van Amundi, waarbij de verantwoordelijkheden worden verdeeld tussen het eerste controleniveau dat door de beleggingsteams zelf wordt verricht en het tweede controleniveau dat door de risicotteams wordt verricht, die voortdurend toezicht houden 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 ratings, gaande van A (de beste scores van het universum) tot G (de slechtste scores). In de ESG-ratingschaal van Amundi stemmen de effecten in de uitsluitingslijst overeen met een G-score. Voor bedrijfsemissanten worden de ESG-prestaties wereldwijd en op basis van het relevante criteria beoordeeld door vergelijking met de gemiddelde prestaties van hun activiteitssector, door een 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 globaal uitgedrukt in de drie dimensies E, S en G of afzonderlijk in een ecologische of sociale factor.

De ESG-scores van Amundi worden opgesteld met behulp van het ESG-analysekader en de ratingmethodologie van Amundi. Hiervoor gebruiken we de volgende brongegevens: Moody, ISS-Oekom, MSCI en Sustainalytics.

De beperkingen van onze methodologie zijn per constructie gelinkt aan het gebruik van ESG-gegevens. Het ESG-gegevenslandschap wordt genormaliseerd, wat een impact kan hebben op de gegevenskwaliteit; de gegevensdekking is ook een beperking. De huidige en toekomstige regelgeving zal de standaardisering van rapportages en verklaringen van ondernemingen waarop ESG-gegevens zijn gebaseerd, verbeteren.

We zijn ons bewust van deze beperkingen die we afzwakken door te combineren.

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

Amundi voert een beleid van engagement bij emittenten (waarin we beleggen en waarin we mogelijk kunnen beleggen), ongeacht het type deelnemingen dat we aanhouden (aandelen en obligaties).

