

Oplysninger om produkter på hjemmesiden i henhold til art. 10, stk. 1, i forordningen om offentliggørelse af oplysninger om bæredygtige finanser for art. 8 underafdelinger

OPSUMMERING

Produktnavn:

CPR Invest – European Strategic Autonomy

Identifikator for juridiske enheder (LEI-kode):

213800O16CE35TFV7J75 TBC

Intet bæredygtigt investeringsmål

Dette finansielle produkt fremmer miljømæssige eller sociale karakteristika, men har ikke som mål bæredygtige investeringer

Finansielle produkters miljømæssige eller sociale karakteristika

Afdelingen fremmer miljømæssige og/eller sociale karakteristika ved at sigte mod at opnå en højere ESG-score end universet.

Ved vurderingen af ESG-scoren for afdelingen og investeringsuniverset vurderes ESG-resultaterne ved at sammenligne et værdipapirs gennemsnitlige resultater med værdipapirudstederens branche med hensyn til hvert af de tre ESG-karakteristika for miljø, sociale forhold og ledelse. Investeringsuniverset er et tilpasset univers på grundlag af søjler med specifik relevans for investeringstemaet, og som ikke vurderer eller omfatter komponenter i henhold til miljømæssige og/eller sociale karakteristika og derfor ikke er beregnet til at være i overensstemmelse med de karakteristika, der fremmes af afdelingen.

Andel af investeringer

Mindst 90 % af afdelingens værdipapirer og instrumenter vil blive anvendt til at opfylde de fremmede miljømæssige eller sociale karakteristika i overensstemmelse med de bindende elementer i afdelingens investeringsstrategi.

Derudover forpligter afdelingen sig til at have mindst 40 % bæredygtige investeringer i henhold til nedenstående diagram. Investeringer i tråd med andre E/S-karakteristika svarer til forskellen mellem den faktiske andel af investeringer i tråd med miljømæssige eller sociale karakteristika og den faktiske andel af bæredygtige investeringer. Den planlagte andel af den øvrige miljøinvestering udgør minimum 40 % og kan ændres, i takt med at de faktiske andele af investeringer i tråd med EU-klassificeringssystemet og/eller sociale investeringer stiger.

Overvågning, metoder, datakilder og deres begrænsninger, due diligence og engagementspolitikker

Alle ESG-data, enten eksternt eller internt behandlet, centraliseres af Responsible Investment Business line, som er ansvarlig for at kontrollere kvaliteten af input og behandlede ESG-output. Denne overvågning omfatter en automatiseret kvalitetskontrol samt en kvalitativ kontrol fra ESG-analytikere, der er specialister i deres sektorer. ESG-scorer opdateres månedligt i Amundis proprietære Stock Rating Integrator-modul (SRI).

Bæredygtighedsindikatorer, der anvendes i Amundi, er afhængige af proprietære metoder. Disse indikatorer gøres løbende tilgængelige i porteføljevaltningsystemet, så porteføljevalterne kan vurdere effekten af deres investeringsbeslutninger.

Endvidere er disse indikatorer integreret i Amundis kontrolramme med ansvarsfordeling mellem det første kontrolniveau, som investeringsteamet selv udfører, og det andet kontrolniveau, som udføres af risikoteamet, som løbende overvåger overholdelsen af miljømæssige eller sociale karakteristika, som selskabet fremmer.

Amundi ESG-vurderingen, der bruges til at bestemme ESG-scoren, er en kvantitativ ESG-score, der omsættes til syv ratings, der går fra A (det bedste scoreunivers) til G (det værste). I Amundi ESG-vurderingsskalaen svarer værdipapirerne på udelukkelseslisten til et G. For virksomheder, der udsteder værdipapirer, vurderes ESG-resultaterne globalt og på det relevante kriterieniveau ved sammenligning med branchegennemsnittet ved hjælp af en kombination af de tre ESG-dimensioner.

Den metode, der anvendes af Amundi ESG-vurderingen, anvender 38 kriterier, der enten er generiske (fælles for alle selskaber uanset deres aktivitet) eller sektorspecifikke, der vægtes efter sektor og overvejes i forhold til deres indvirkning på omdømme, driftseffektivitet og regler over for en udsteder. Amundi ESG-vurderinger vil sandsynligvis blive udtrykt globalt på de tre E-, S- og G-dimensioner eller individuelt på en hvilken som helst miljømæssig eller social faktor.

Amundis ESG-scorer er baseret på Amundis ESG-analyseramme og -scoringmetode. Vi indhenter data fra følgende kilder til ESG-vurderinger: Moody, ISS-Oekom, MSCI og Sustainalytics.

Vores metodebegrænsninger er baseret på konstruktion forbundet med brugen af ESG-data. ESG-datalandskabet er i øjeblikket ved at blive standardiseret, hvilket kan påvirke datakvaliteten. Datadækning er også en begrænsning. Den nuværende og fremtidige lovgivning vil forbedre den standardiserede rapportering og de selskabsoplysninger, som ESG-data er afhængige af.

Vi er opmærksomme på disse begrænsninger, som vi afhjælper ved hjælp af en kombination af tilgange.

Hver måned genberegnes ESG-scoren i henhold til den kvantitative Amundi-metode. Resultatet af denne beregning gennemgås derefter af ESG-analytikerne, som udfører en kvalitativ "prøvekontrol" af sin sektor baseret på forskellige kontroller.

Amundi ansætter investerede eller potentielle investerede selskaber på udstederniveau uanset beholdningstype (egenkapital og obligationer).