

**Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten**

**Name des Produkts:** Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF) **Unternehmenskennung (LEI-Code):** 5299000BIU0CW91UOG52

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. In dieser Verordnung ist kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten festgelegt. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?**

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> <b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> <b>X</b> <b>Nein</b>
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____ <ul style="list-style-type: none"> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____	<input checked="" type="checkbox"/> <b>X</b> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es <b>62,25 %</b> an nachhaltigen Investitionen <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> <b>X</b> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> <b>X</b> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> <b>X</b> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



**Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?**

Das Teilsondervermögen förderte ökologische und/oder soziale Merkmale durch die Verwendung des MDAX® ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index) (der "Index"). Das Teilsondervermögen fördert ökologische und/oder soziale Merkmale, einschließlich durch die Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance-Ratings ("ESG") des ESG-Bereichs des Datenanbieters Sustainalytics. Die MDAX® ESG+ (NR) EUR verfolgt die Performance des MDAX® Index, wobei ESG-Ausschlussfilter und Bewertungsmethoden der Sustainalytics-ESG verwendet werden, um mindestens 20 Prozent der Unternehmen aus dem MDAX® auszuschließen.

Das Teilsondervermögen wurde am 22. November 2022 von einem Produkt nach Artikel 6 der Offenlegungsverordnung zu einem Produkt nach Artikel 8 der Offenlegungsverordnung umklassifiziert.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Teilsondervermögen repliziert kontinuierlich den MDAX® ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index), dessen ESG-Rating des Datenanbieters Sustainalytics auch das ESG-Rating des Portfolios darstellt. Der ESG-Score des MDAX® ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index) des Datenanbieters Sustainalytics am Ende des Zeitraums betrug:

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>MDAX ESG+</b>	<b>69,76</b>	<b>100%</b>

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Die Nachhaltigkeitsindikatoren wurden nicht mit früheren Zeiträumen verglichen, da die Vorgaben der Offenlegungs-Verordnung im vorangegangenen Berichtszeitraum noch nicht in Kraft war.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die Ziele der nachhaltigen Investitionen bestanden darin, in Unternehmen zu investieren, die zwei Kriterien erfüllen:

- 1) beste Umwelt- und Sozialpraktiken anwenden und
- 2) keine Produkte herstellen oder Dienstleistungen erbringen, die der Umwelt und der Gesellschaft schaden.

Damit davon ausgegangen werden kann, dass das Unternehmen, in das investiert wird, einen Beitrag zu den oben genannten Zielen leistet, muss es in seinem Tätigkeitsbereich bei mindestens einem seiner wesentlichen Umwelt- oder Sozialfaktoren zu den "Best Performern" gehören.

Die Definition des Begriffs "Best Performer" basiert auf der Amundi Group eigenen ESG-Methode, die darauf abzielt, die ESG-Leistung eines Unternehmens, in das investiert wird, zu messen. Um als "Best Performer" eingestuft zu werden, muss ein Unternehmen, in das investiert wird, innerhalb seines Sektors bei mindestens einem wesentlichen Umwelt- oder Sozialfaktor die drei besten Bewertungen (A, B oder C auf einer Bewertungsskala von A bis G) erzielen. Wesentliche Umwelt- und Sozialfaktoren werden auf Branchenebene ermittelt. Die Identifizierung der wesentlichen Faktoren basiert auf dem Amundi Group ESG-Analyseverfahren, das außerfinanzielle Daten und eine qualitative Analyse der damit verbundenen Branchen- und Nachhaltigkeitsthemen kombiniert. Faktoren, die als wesentlich identifiziert werden, leisten einen Beitrag von mehr als 10 % zum gesamten ESG-Score. Für den Energiesektor beispielsweise sind folgende Faktoren wesentlich: Emissionen und Energie, biologische Vielfalt und Umweltverschmutzung, Gesundheit und Sicherheit, lokale Gemeinschaften und Menschenrechte. Einen vollständigen Überblick über die Sektoren und Faktoren finden Sie in der Erklärung zur Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken von Amundi Group, die unter [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) verfügbar ist.

Um zu den oben genannten Zielen beizutragen, sollte das Unternehmen, in das investiert wird, nicht in nennenswertem Umfang an Aktivitäten beteiligt sein (z. B. Tabak, Waffen, Glücksspiel,

Kohle, Luftfahrt, Fleischproduktion, Herstellung von Düngemitteln und Pestiziden, Produktion von Einwegplastik), die nicht mit diesen Kriterien vereinbar sind.

Der nachhaltige Charakter einer Investition wurde auf der Ebene des Unternehmens, in das investiert wurde, bewertet.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● ***Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?***

Um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keines der Umwelt- oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt ("do not significantly harm", "DNSH"), setzt Amundi Group zwei Filter ein:

Der erste DNSH-Filter stützt sich auf die Überwachung der obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, sofern robuste Daten verfügbar sind (z. B. die Treibhausgasintensität von Unternehmen, in die investiert wird), und zwar durch eine Kombination von Indikatoren (z. B. die Kohlenstoffintensität) und spezifischen Schwellenwerten oder Regeln (z. B. dass die Kohlenstoffintensität des Unternehmens, in das investiert wird, nicht zum letzten Dezil des Sektors gehört).

Amundi Group berücksichtigt bereits bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen im Rahmen seiner Ausschlusspolitik als Teil der Grundsätze für nachhaltiges Investieren von Amundi Group. Diese Ausschlüsse, die zusätzlich zu den oben genannten Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschlüsse für kontroverse Waffen, Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact, Kohle und Tabak.

Neben den spezifischen Nachhaltigkeitsfaktoren, die vom ersten Filter abgedeckt werden, hat Amundi Group einen zweiten Filter definiert, der die oben genannten obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen nicht berücksichtigt, um zu überprüfen, ob das Unternehmen im Vergleich zu anderen Unternehmen seines Sektors in ökologischer oder sozialer Hinsicht insgesamt nicht schlecht abschneidet, was einem Umwelt- oder Sozial-Score von E oder höher unter Verwendung des ESG-Ratings von Amundi Group entspricht.

– ***Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?***

Die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen wurden wie im ersten DNSH-Filter ("Do not significantly harm") oben beschrieben berücksichtigt:

Der erste DNSH-Filter stützt sich auf die Überwachung der obligatorischen Hauptindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, wenn durch die Kombination der folgenden Indikatoren und spezifischer Schwellenwerte oder Regeln zuverlässige Daten verfügbar sind und die die Überwachung der folgenden PAIs umfassen:

- eine CO<sub>2</sub>-Intensität, die im Vergleich zu anderen Unternehmen in ihrem Sektor nicht zum letzten Dezil gehört (gilt nur für Sektoren mit hoher Intensität), und
- Die Diversität des Verwaltungsrats gehört im Vergleich zu anderen Unternehmen des Sektors nicht zum letzten Dezil, und
- keine Kontroversen in Bezug auf Arbeitsbedingungen und Menschenrechte haben.
- keine Kontroversen in Bezug auf biologische Vielfalt und Umweltverschmutzung

Amundi Group berücksichtigt im Rahmen ihrer investmentbezogenen Ausschlusspolitik als Teil der Grundsätze für nachhaltiges Investieren von Amundi Group bereits bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen (Principal Adverse Impacts). Diese Ausschlüsse, die zusätzlich zu den oben genannten Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschluss von kontroversen Waffen, Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact, Kohle und Tabak.

– ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte wurden in unsere ESG-Bewertungsmethodik integriert. Unser firmeneigenes ESG-Rating-Tool bewertet Emittenten anhand der verfügbaren Daten von unseren Datenanbietern. Das Modell verfügt beispielsweise über ein spezielles Kriterium mit der Bezeichnung "Community Involvement & Human Rights", das auf alle Sektoren angewendet wird, zusätzlich zu anderen menschenrechtsbezogenen Kriterien wie sozial verantwortliche Lieferketten, Arbeitsbedingungen und Arbeitsbeziehungen. Darüber hinaus führen wir mindestens vierteljährlich ein Kontroversen-Monitoring durch, das Unternehmen einschließt, bei denen Menschenrechtsverletzungen festgestellt wurden. Wenn Kontroversen auftraten, bewerteten Analysten die Situation und wendeten eine Punktzahl auf die Kontroverse an (unter Verwendung unserer firmeneigenen Bewertungsmethodik) und bestimmten die beste Vorgehensweise. Die Bewertungen der Kontroversen werden vierteljährlich aktualisiert, um den Trend und die Abhilfemaßnahmen zu verfolgen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

*Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.*

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



**Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Teilsondervermögen berücksichtigte alle verbindlichen wichtigsten nachteiligen Auswirkungen gemäß Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, die auf die Strategie des Fonds zutreffen, und stützte sich auf eine Kombination aus Ausschlussgrundsätzen (normativ und Sektor bezogen), der Integration von ESG-Ratings in den Anlageprozess, Engagement und Abstimmungsansätzen:

- **Ausschluss:** Amundi Group hat normative, tätigkeitsbasierte und Sektor basierte Ausschlussregeln definiert, die einige der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren abdecken, die in der Offenlegungsverordnung aufgeführt sind.
- **Engagement:** Engagement ist ein kontinuierlicher und zielgerichteter Prozess, der darauf abzielt, die Aktivitäten oder das Verhalten von Unternehmen, in die investiert wird, zu beeinflussen. Das Ziel der Engagement-Aktivitäten kann in zwei Kategorien eingeteilt werden: einen Emittenten dazu zu bewegen, die Art und Weise, wie er die ökologische und soziale Dimension integriert, zu verbessern, einen Emittenten dazu zu bewegen, seine Auswirkungen auf Umwelt-, Sozial- und Menschenrechtsfragen oder andere Nachhaltigkeitsfragen, die für die Gesellschaft und die Weltwirtschaft von Bedeutung sind, zu verbessern.
- **Abstimmen:** Die Abstimmungspolitik von Amundi Group beruht auf einer ganzheitlichen Analyse aller langfristigen Themen, die die Wertschöpfung beeinflussen können, einschließlich wesentlicher ESG-Themen. Weitere Informationen finden Sie in Amundi Group's Abstimmungspolitik.
- **Überwachung von Kontroversen:** Amundi Group hat ein System zur Verfolgung von Kontroversen entwickelt, das sich auf drei externe Datenanbieter stützt, um Kontroversen und deren Schweregrad systematisch zu verfolgen. Dieser quantitative Ansatz wird dann durch eine eingehende Bewertung jeder schweren Kontroverse durch ESG-Analysten und die regelmäßige Überprüfung ihrer Entwicklung ergänzt. Dieser Ansatz gilt für alle Fonds von Amundi Group.

Informationen darüber, wie die obligatorischen Indikatoren für die wichtigsten negativen Auswirkungen verwendet werden, finden Sie in der Erklärung zur Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken von Amundi Group, die unter [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) abrufbar ist.



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Größe Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
DEUTSCHE LUFTHANSA	Industrie	7,85 %	DEU
FRESEN MED CARE AG	Gesundheit	7,18 %	DEU
GEA GROUP AG	Industrie	4,60 %	DEU
PUMA SE	Zyklische Konsumgüter	4,57 %	DEU
KNORR-BREME AG	Industrie	3,81 %	DEU
SCOUT24 AG	Kommunikationsdienste	3,56 %	DEU
NEMETSCHKE AG	IT	3,55 %	DEU
HUGO BOSS AG ORD	Zyklische Konsumgüter	3,43 %	DEU
LEG IMMOBILIEN AG	Immobilien	3,21 %	DEU
HELLOFRESH AG	Nicht-zyklische Konsumgüter	3,04 %	DEU
CARL ZEISS MEDITEC	Gesundheit	2,98 %	DEU
EVONIK INDUSTRIES AG	Grundstoffe	2,94 %	DEU
THYSSEN KRUPP AG	Grundstoffe	2,91 %	DEU
AIXTRON AG	IT	2,88 %	DEU

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 22.11.2022 bis 30.06.2023, der Fonds wurde im November als Artikel 8 eingestuft**

GERRESHEIMER AG (XETRA)	Gesundheit	2,60 %	DEU
----------------------------	------------	--------	-----

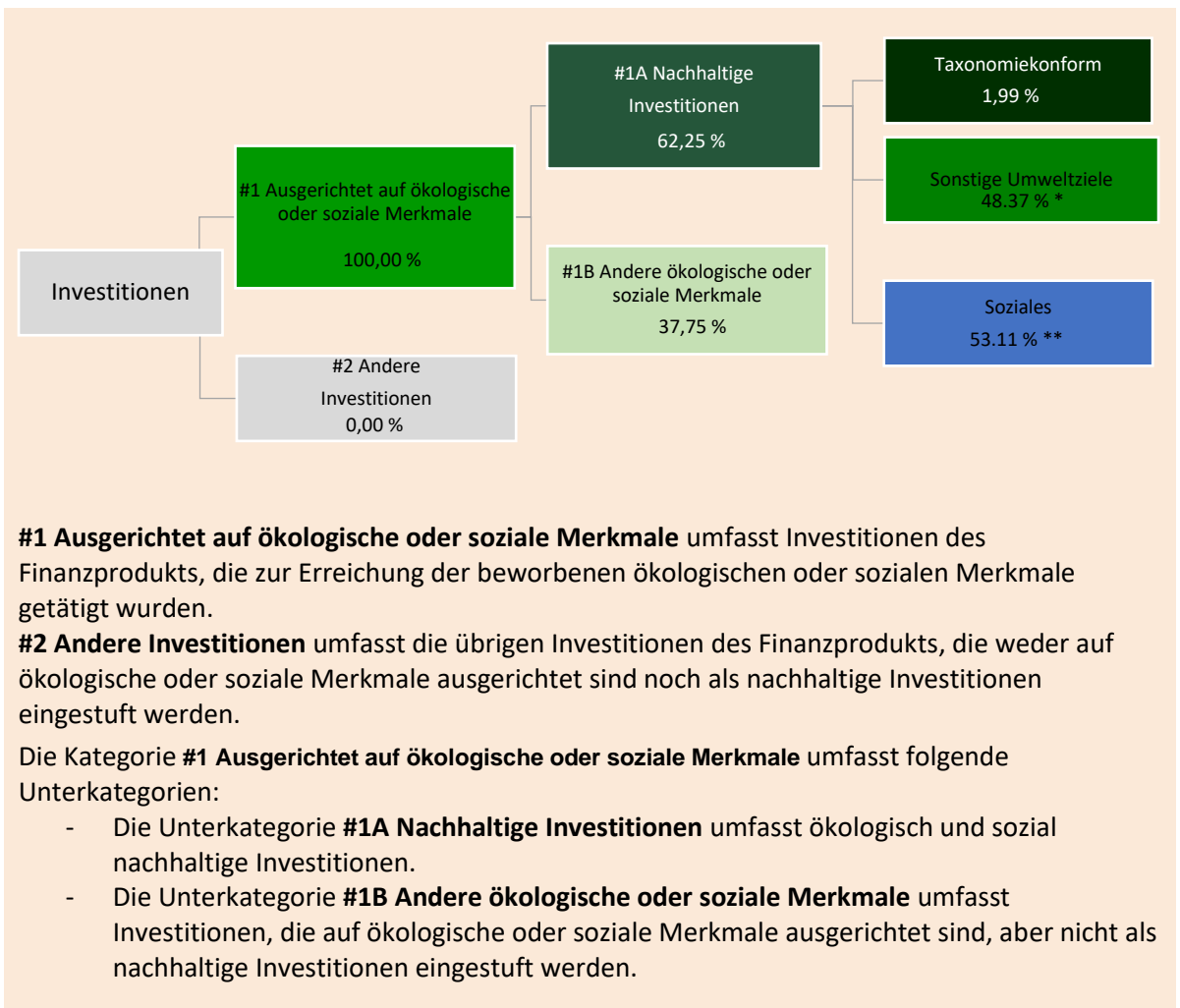
Die Daten in der obigen Tabelle basieren auf einem einzelnen Portfolio-Beobachtungspunkt zum Berichtszeitpunkt 30. Juni 2023.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



**In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
<i>Industrie</i>	27,05 %
<i>Gesundheit</i>	15,27 %
<i>Grundstoffe</i>	13,86 %
<i>IT</i>	13,49 %
<i>Kommunikationsdienste</i>	9,79 %
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	9,21 %
<i>Immobilien</i>	4,47 %
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	3,04 %
<i>Finanzwesen</i>	2,32 %
<i>Öffentliche Dienstleistungen</i>	1,49 %
<i>Liquide Mittel</i>	0,00 %

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:  
 - **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die



**Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?**

Der Fonds bewirbt sowohl ökologische als auch soziale Merkmale. Der Fonds verpflichtet sich zwar nicht, Investitionen zu tätigen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Jedoch hat der Fonds im Berichtszeitraum 1,99 % in nachhaltige Investitionen investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen. Diese Investitionen trugen zu den Zielen der EU-Taxonomie im Hinblick auf die Verpflichtung zum Klimaschutz oder Klimaschutzmaßnahmen bei.

investiert wird, widerspiegeln  
 - **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen.  
 - **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die Konformität der Unternehmen, in die investiert wird, mit den oben genannten Zielen der EU-Taxonomie wird anhand von Umsatz- bzw. Ertragszahlen und/oder Daten zu grünen „Use of Proceeds“-Anleihen gemessen.

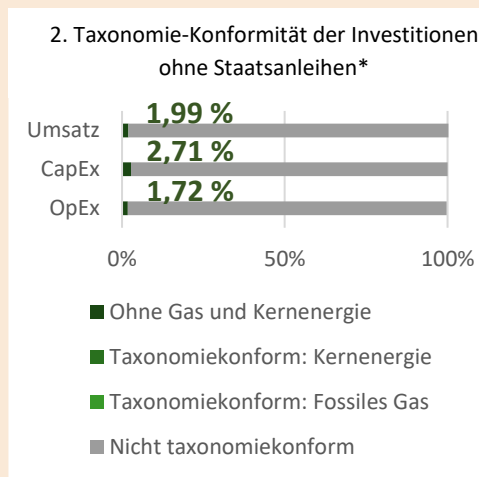
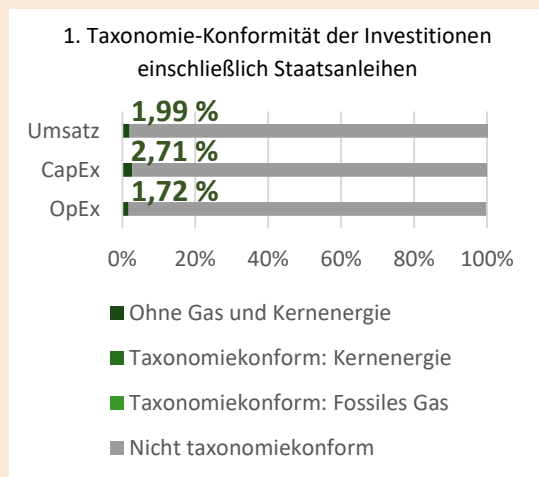
● **Wird mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie<sup>1</sup> investiert?**

Ja:  
 In fossiles Gas     In Kernenergie  
 Nein

Verlässige Daten zur Angleichung an die EU-Taxonomie für fossiles Gas und Kernenergie waren im Berichtszeitraum nicht verfügbar.

<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels (Klimaschutz) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

**In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**




\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin,



dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2- armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.


 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, **die die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Zum 30.06.2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds an Übergangstätigkeiten anhand von Umsatz- bzw. Ertragszahlen und/oder Daten zu grünen „Use of Proceeds“-Anleihen als Indikator 0% und der Anteil der Investitionen an ermöglichenden Tätigkeiten betrug 0% .

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Die Nachhaltigkeitsindikatoren wurden nicht mit früheren Zeiträumen verglichen, da die Verordnung noch nicht in Kraft war.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit nicht an der Taxonomie ausgerichteten Umweltzielen lag am Ende des Berichtszeitraums bei **48,37 %**. \* Ein Teil dieser Investitionen trägt auch zu einem sozialen Ziel bei.  
Der Anteil von **48,37 %** ist darauf zurückzuführen, dass einige Emittenten der im Teilsondervermögen gehaltenen Vermögensgegenstände zwar als nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung gelten (können), aber ein Teil ihrer Aktivitäten nicht mit den EU-Taxonomiestandards in Einklang zu bringen ist oder für die noch keine Daten zur Verfügung stehen, um eine EU-Taxonomiebewertung durchzuführen.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen lag am Ende des Berichtszeitraums bei **53,11%**.  
\*\* Ein Teil dieser Investitionen trägt auch zu einem Umweltziel bei.

 **Welche Investitionen fielen unter "Andere Investitionen", welcher Anlagezweck wurden mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz**

Unter "#2 Andere Investitionen" wurden Barmittel und Instrumente zum Zwecke des Liquiditäts- und Portfoliorisikomanagements erfasst.

 **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und gleichzeitig den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren. Durch verbindliche Elemente in der Indexmethodik wird sichergestellt, dass die ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu jedem Zeitpunkt der Neugewichtung erfüllt werden. Insbesondere verfolgt der MDAX ESG+ (NR) EUR die Performance des MDAX Index, wobei ESG-Ausschlussfilter und Bewertungsmethoden der Sustainalytics-ESG verwendet werden, um mindestens 20 Prozent der Unternehmen aus dem MDAX auszuschließen. Die Produktstrategie stützt sich auch auf eine

gezielte Ausschlusspolitik (normativ und sektoriell), wie in den „Grundsätzen für nachhaltiges Investieren“ von Amundi Group näher beschrieben ist: <https://www.amundi.lu>



## Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Der MDAX® ESG+ (NR) EUR ist ein Aktienindex, der auf dem MDAX® basiert, der mittelgroße Unternehmen, so genannte Midcaps, aus den klassischen Industriebranchen, darunter Medien, Chemie, Industrie und Finanzdienstleistungen sowie aus Technologie umfasst. Der MDAX® ESG+ (NR) EUR unterscheidet sich vom MDAX®, in dem er für die Auswahl der Unternehmen ESG-Ausschlussfilter und Bewertungs-Methodik des ESG-Bereichs des Datenanbieters International Shareholder Services Inc. verwendet, um mindestens 20 Prozent der Unternehmen des MDAX® auszuschließen

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
<b>MDAX ESG+</b>	69,76	100%
<b>MDAX Index</b>	68,01	100%

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren. Die Nachhaltigkeitsindikatoren des Produkts entsprechen insgesamt denjenigen des Indexes.

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
<b>MDAX ESG+</b>	69,76	100,00%

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren. Siehe Vergleich der Finanzproduktleistung mit der des Referenzwerts

	1 Jahr
	30/06/2023
<b>Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF)</b>	7,66%
<b>MDAX ESG+</b>	9,97%
<b>Spread</b>	-2,31%

● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und gleichzeitig den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren. Im Folgenden finden Sie den Vergleich der Performance des Finanzprodukts mit der des breiten Marktindex.

	1 Jahr
	30/06/2023
<b>Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF)</b>	7,66%
<b>MDAX Index</b>	6,92%
<b>Spread</b>	0,74%