Fonds-Factsheet

Die Stuttgarter
Der Vorsorge-Versicherer

Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS ETF DR EUR (A)

16. April 2024

Strategie

Der ETF bietet eine Anlage in festverzinsliche Investment-Grade-Titel, die von Unternehmen (engl. 'Corporates') der Eurozone begeben werden und Unternehmensanleihen mit Emittenten aus den Sektoren Alkohol, Tabak, Glücksspiel, Kriegswaffen, Kernenergie, Erwachsenenunterhaltung, zivile Schusswaffen und genetisch veränderte Organismen ausschließt. Das Ziel dieses Anleihefonds besteht darin, die Wertentwicklung des Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate SRI Index nachzubilden und den Tracking Error zwischen dem Nettoinventarwert des Teilfonds und der Wertentwicklung des Index zu minimieren. Der Teilfonds strebt an, ein Tracking-Error-Niveau zwischen dem Teilfonds und seinem Index zu erreichen, das in der Regel nicht mehr als 1% beträgt.

Basisdaten

Fonds-Nr. / ISIN	**473 / LU1437018168**
Fondsgesellschaft	**Amundi Luxembourg S.A.**
Depotbank	**CACEIS Bank S.A., Luxembourg**
Fondswährung	**EUR**
Auflagedatum	**29.06.2016**
Ertragsverwendung	**thesaurierend**

Aktuelle Daten

Fondsvolumen	**3,35 Mrd. EUR** (29.02.2024)
Rücknahmepreis	**49,95 EUR** (16.04.2024)

Kosten

Laufende Kosten	**0,14 %** (10.11.2023)
Rückvergütung	**0,00 %**

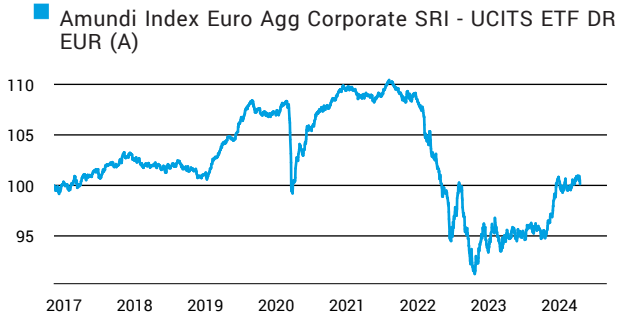
Risikoklasse nach KID (10.11.2023)

geringes Risiko — höheres Risiko

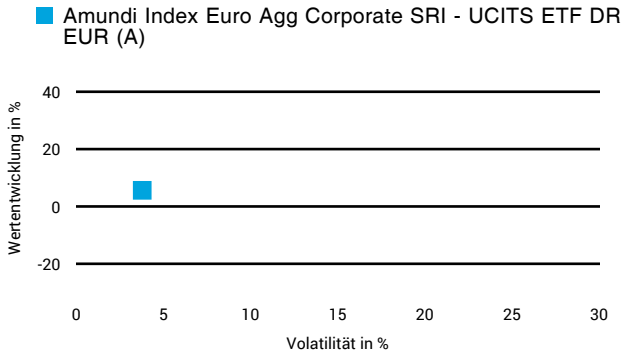
1 **2** 3 4 5 6 7

potentiell geringerer Ertrag — potentiell höherer Ertrag

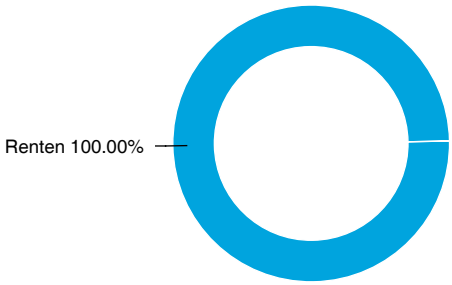
Wertentwicklung (indexiert)



1 Jahres Risiko Rendite Diagramm



Vermögensaufteilung



Performance (16.04.2024)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Seit Auflage
Fonds	**+5,64 %**	**-8,08 %**	**-3,98 %**	**+0,13 %**

Performance p.a. (16.04.2024)

	1 Jahr p.a.	3 Jahre p.a.	5 Jahre p.a.	Seit Auflage p.a.
Fonds	**+5,62 %**	**-2,77 %**	**-0,81 %**	**+0,02 %**

Diese Darstellung dient ausschließlich der Produktinformation und stellt weder eine Anlageberatung noch eine Produktempfehlung dar. Wertentwicklungsdarstellungen nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese sind nicht prognostizierbar. Weitergehende Informationen sind den gesetzlichen Pflichtveröffentlichungen der Fondsgesellschaft zu entnehmen, die Sie bei uns kostenlos anfordern können.

Stuttgarter Lebensversicherung a. G., Stand: 04/2024 - 473

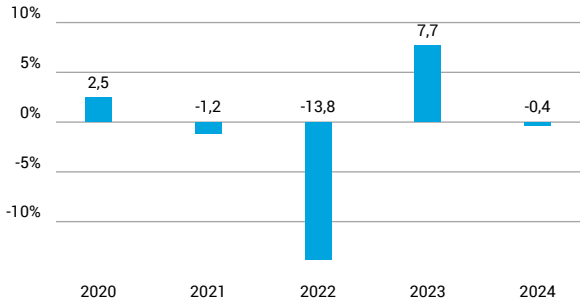
Fonds-Factsheet

Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS ETF DR EUR (A)

16. April 2024

Wertentwicklung nach Kalenderjahren

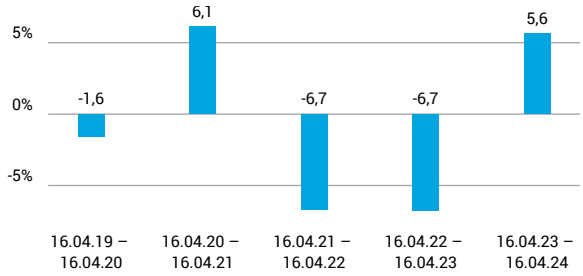
Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS ETF DR EUR (A)



Quelle: CleverSoft FondsDB™ Stand: 16.04.2024

Rollierende Wertentwicklung

Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS ETF DR EUR (A) (brutto)



Quelle: CleverSoft FondsDB™ Stand: 16.04.2024

Kennzahlen

Sharpe Ratio (1 Jahr)	**0,50**
1-Monats-Tief in %	**-0,91**

Volatilität

1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre	Seit Auflage
3,78 %	**4,09 %**	**-**	**3,52 %**

Die 5 größten Länder (29.02.2024)

Frankreich	**22,46 %**
USA	**20,27 %**
Deutschland	**13,09 %**
Vereinigtes Königreich	**8,17 %**
Spanien	**6,73 %**

Die 5 größten Engagements (29.02.2024)

CREDIT SUISSE GROUP AG 7.75 03/01/2029	**0,19 %**
RABOBANK NEDERLAND NV 4.12500% 10-14.07.25	**0,14 %**
BBG0162QT3D3 JPMORGAN CHASE AND CO 3/30	**0,13 %**
MORGAN STANLEY SR UNSECURED 03/29 VAR	**0,12 %**
JPMORGAN CHASE & CO 1.09% 11/3/2027	**0,12 %**

Die 5 größten Laufzeiten__ __(29.02.2024)

2 - 3 Jahre	**16,19 %**
3 - 4 Jahre	**14,18 %**
1 - 2 Jahre	**12,01 %**
4 - 5 Jahre	**11,60 %**
5 - 6 Jahre	**10,44 %**

Diese Darstellung dient ausschließlich der Produktinformation und stellt weder eine Anlageberatung noch eine Produktempfehlung dar. Wertentwicklungsdarstellungen nach der BVI-Methode (ohne Berücksichtigung von Ausgabeaufschlägen). Historische Wertentwicklungen lassen keine Rückschlüsse auf eine ähnliche Entwicklung in der Zukunft zu. Diese sind nicht prognostizierbar. Weitergehende Informationen sind den gesetzlichen Pflichtveröffentlichungen der Fondsgesellschaft zu entnehmen, die Sie bei uns kostenlos anfordern können.

Stuttgarter Lebensversicherung a. G., Stand: 04/2024 - 473

ESG Information

Stand: 09.04.2024

Gegenstand dieses Dokuments sind Nachhaltigkeitsinformationen zu diesem Finanzprodukt. Es handelt sich um Werbematerial. Für Informationen über die berücksichtigten Umweltziele lesen Sie bitte aufmerksam die Nachhaltigkeitsinformationen des Herstellers. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS ETF DR EUR (A)

ISIN / WKN	LU1437018168 / A2ATY6
Emittent / Hersteller	Amundi Luxembourg S.A.
Benchmark	Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI
EU-Offenlegungskategorisierung*	Artikel 8 Einstufung nach Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR)
PAI Berücksichtigung**	Ja, für folgende Kriterien: Treibhausgas-Emissionen; Wasser; Abfälle; Biologische Diversität; Soziale und Arbeitnehmerbelange
SFDR vorvertragliche Informationen***	Link
SFDR regelmäßige Informationen***	Link
SFDR Website Informationen***	Link
ESG-Fokus	-
Aktualisierung durch Hersteller	22.02.2024

* Artikel 6: Finanzprodukte, die weder ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, noch nachhaltige Investitionen anstreben; Artikel 8: Finanzprodukte, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, und die Unternehmen, in die investiert wird, wenden Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung an; Artikel 9: Finanzprodukte, die nachhaltige Investitionen anstreben.

** PAI (Principle Adverse Impact) sind die negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

*** SFDR - Sustainable Finance Disclosure Regulation (Offenlegungsverordnung)

Mindestanteil von nachhaltigen Anlagen nach SFDR

25,00 %

ESG Information

Stand: 09.04.2024

Anlagestrategie

Dieser Teilfonds wird passiv verwaltet.Das Ziel dieses Teilfonds besteht darin, die Wertentwicklung des Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index nachzubilden und den Tracking Error zwischen dem Nettoinventarwert des Teilfonds und der Wertentwicklung des Index zu minimieren. Der Teilfonds strebt an, einen Tracking Error des Teilfonds und seines Index zu erreichen, der normalerweise nicht mehr als 1 % beträgt.Der Index ist ein Gesamtertragsindex: Die von den Indexbestandteilen gezahlten Kupons sind in der Indexrendite enthalten.Der Bloomberg MSCI Euro Corporate ESG Sustainability SRI Index ist ein Anleihenindex, der die festverzinslichen, auf Euro lautenden Wertpapiere von Unternehmen mit Investment Grade darstellt. Er befolgt die Regeln des Bloomberg Euro Aggregate Corporate Index (der „Hauptindex“) und wendet sektorale und zusätzliche ESG-Kriterien für die Eignung der Wertpapiere an.Weitere Informationen zur Zusammensetzung des Index und seinen Betriebsvorschriften finden Sie im Prospekt und unter: BloombergDer Indexwert ist über Bloomberg (I35570EU) erhältlich.Das Engagement im Index wird durch eine direkte Nachbildung erreicht, vornehmlich durch direkte Anlagen in übertragbaren Wertpapieren und/oder anderen zulässigen Vermögenswerten, die die Indexbestandteile repräsentieren, wobei die jeweiligen prozentualen Anteile sehr stark den Anteilen im Index entsprechen.Der Teilfonds beabsichtigt, ein Modell der stichprobenartigen Nachbildung zu implementieren, um die Wertentwicklung des Index nachzubilden, und es ist daher nicht zu erwarten, dass der Teilfonds jede einzelne zugrunde liegende Komponente des Index zu jeder Zeit oder im gleichen Verhältnis wie ihre Gewichtung im Index halten wird. Der Teilfonds kann auch einige Wertpapiere halten, die keine Bestandteile des Index sind.Der Anlageverwalter kann Derivate einsetzen, um Zu- und Abflüsse zu bewältigen, und auch, wenn sie eine bessere Positionierung in einem Indexbestandteil ermöglichen. Um zusätzliche Erträge zum Ausgleich seiner Kosten zu generieren, kann der Teilfonds auch Wertpapierleihgeschäfte tätigen.Dividendenpolitik: Die thesaurierende Anteilsklasse behält automatisch den Nettoanlagegewinn des Teilfonds ein und legt ihn wieder auf Teilfondsebene an, während die ausschüttende Anteilsklasse jährlich Dividenden zahlt.Die empfohlene Mindesthaltedauer beträgt 4 Jahre.Die Anteile des Teilfonds werden an mindestens einer Börse notiert und gehandelt. Unter normalen Umständen können Sie während der Handelszeiten der Börsen mit Anteilen handeln, sofern die Market Maker die Marktliquidität aufrechterhalten können. Nur zugelassene Teilnehmer (z.B. ausgewählte Finanzinstitute) können direkt Anteile direkt mit dem Teilfonds auf dem Primärmarkt handeln. Weitere Einzelheiten finden Sie im Prospekt des OGAW.

Rechtliche Informationen

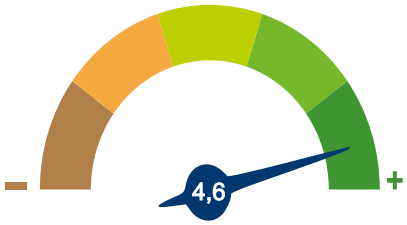
Die offengelegten ESG-Informationen werden der cleversoft GmbH von der genannten Kapitalanlagegesellschaft (Hersteller) und Scope Fund Analysis zur Verfügung gestellt. Die ESG-Informationen werden mit größtmöglicher Sorgfalt erstellt, regelmäßig geprüft und aktualisiert. Trotz aller Sorgfalt können sich die Informationen inzwischen verändert haben oder auf fehlerhaften Daten Dritter basieren. Die Versicherungsgesellschaft und cleversoft GmbH können keine Gewähr für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Aktualität der ausgewiesenen Daten übernehmen. Die in dem ESG-Dokument publizierten Informationen stellen keine Empfehlung, Angebot oder Aufforderung zur Investition in einen Fonds dar.

ESG Information

Stand: 09.04.2024

Amundi Index Euro Agg Corporate SRI - UCITS ETF DR EUR (A)

Das Scope ESG-Rating basiert auf 15 Haupt- und 88 Sub-Ausschlusskriterien. Aus der erreichten Prozentzahl für die verwendeten Ausschlusskriterien ergibt sich eine Bewertung für jede der drei Dimensionen (E)nviromental, (S)ocial und (G)overnance. Die endgültige Bewertungskennzahl berechnet sich abschließend aus der prozentualen Verteilung aller Ausschlusskriterien über die drei ESG-Dimensionen als Gewichtungsfaktor hinweg. Die Skala reicht von null bis fünf, wobei fünf die bestmögliche Bewertung darstellt.



Scope ESG-Rating

Information zum Scope ESG-Rating

Scope ESG-Rating Skala von 0 bis 5
(0 = schlechtester Wert, 5 = bester Wert)

Umwelt

1 2 3 4 5

Soziales

1 2 3 4 5

Unternehmensführung

Keines der Ausschlusskriterien wurde berücksichtigt.

Welche Nachhaltigkeitskriterien werden mit einbezogen?

ESG-Reporting	Nein	Engagement	Ja
ESG-Research	Ja	Ausschlusskriterien	Ja
Best-of-Class	Nein	Best-in-Class	Ja
Themenansatz	Nein		

Quelle: Scope Fund Analysis

Sind bestimmte Investitionen ausgeschlossen?

Umwelt		Soziales		Unternehmensführung	
Automobilindustrie	Nein	Menschenrechtsverstöße	Nein	Verstoß gegen Global Compact	Nein
Chemie	Nein	Arbeitsrechtsverstöße	Nein	Unzulässige Geschäftspraktiken	Nein
Gentechnik	Ja	Pornographie	Ja		
Kernkraft	Ja	Suchtmittel	Ja		
Fossile Energieträger	Ja	Tierschutzverstöße	Nein		
Luftfahrt	Nein	Waffen / Rüstung	Ja		
Umweltschädliches Verhalten	Nein				

Quelle: Scope Fund Analysis

ESG-Glossar

Ausschlusskriterien - Ein Ansatz, bei dem bestimmte Investments oder Investmentklassen aus dem Investmentuniversum ausgeschlossen werden.
Best-in-Class - Auswahl oder Gewichtung der sich am besten entwickelnden Unternehmen oder Assets auf Grundlage einer ESG-Analyse innerhalb eines bestimmten Investment-Universums.
Best-of-Class - Anlagestrategie, nach der auf Basis von ESG-Kriterien die besten Unternehmen über sämtliche Branchen und Kategorien hinweg ausgewählt werden.
Engagement - Langfristiger Dialog von Investoren und Unternehmen mit dem Ziel, die Unternehmensführung unter Berücksichtigung von sozialen, ethischen und ökologischen Kriterien zu gewinnen.
ESG-Kriterien - Englisch für Environmental, Social and Governance - Umwelt, Soziales und gute Unternehmensführung. Bezieht sich auf ein breites Spektrum nicht-finanzieller Indikatoren für die Nachhaltigkeitsfonds.
ESG-Reporting - Die Offenlegung nicht-finanzieller Kennzahlen und Informationen zu ESG-Kriterien auf Fonds- und Unternehmensebene.
ESG-Research - Spezialisierte Research-Anbieter bieten Analysen zu Staaten und Unternehmen unter Berücksichtigung der Kriterien Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) an. Materielle im Rahmen der klassischen Finanzanalyse vernachlässigte ESG-Risiken und Chancen werden identifiziert und bewertet.
Global Compact - Der UN Global Compact (Globaler Pakt der Vereinten Nationen) verpflichtet Unternehmen zur Einhaltung sozialer und ökologischer Mindeststandards. Wichtige Prinzipien des UN Global Compact sind Menschenrechte, Vereinigungsfreiheit, Abschaffung von Zwangs- und Kinderarbeit, Umweltschutz und Korruptionsbekämpfung.
Themenansatz - Investitionen in Themen oder Assets, die mit der Förderung von Nachhaltigkeit zusammenhängen. Thematische Fonds haben ESG-Themenschwerpunkte, z. B. Klimawandel und Ökoeffizienz.