

Informazioni precontrattuali online in base all'art. 10(1) del Regolamento SFDR per i comparti ex art. 8

SINTESI

Denominazione del Prodotto: AMUNDI FUNDS
MONTPENSIER GLOBAL CONVERTIBLE BOND

Codice LEI (Legal entity identifier): 529900LZ9GLOP969J692

Obiettivo di investimento sostenibile non previsto

Questo prodotto finanziario promuove caratteristiche ambientali o sociali, ma non prevede come suo obiettivo l'investimento sostenibile.

Questo prodotto finanziario si impegna ad effettuare investimenti sostenibili.

Caratteristiche ambientali o sociali del prodotto finanziario

Il Comparto promuove caratteristiche ambientali e/o sociali ponendosi come obiettivo quello di ottenere un punteggio ESG superiore a quello dell'indice REFINITIV CONVERTIBLE GLOBAL HEDGED EUR ("Indice di Riferimento"). Nel determinare il punteggio ESG del Comparto e dell'Indice di Riferimento, la performance ESG viene valutata confrontando il rendimento medio di un titolo con quello del settore in cui opera il relativo emittente, con riferimento a ciascuna delle tre caratteristiche ESG: ambientale, sociale e di governance. L'Indice di Riferimento è un indice di mercato a base ampia, il quale non valuta o seleziona i propri componenti in base a caratteristiche ambientali e/o sociali e pertanto non è inteso per essere in linea con le caratteristiche di cui il Comparto è promotore. Non è stato designato un Indice di Riferimento ESG.

Quote di investimento

Almeno il 75% degli investimenti del Comparto sarà utilizzato per rispettare le caratteristiche ambientali o sociali di cui esso è promotore, in conformità agli elementi vincolanti della strategia di investimento del Comparto. Inoltre, il Comparto si impegna a destinare una quota minima del 10% ad investimenti sostenibili come descritto nella tabella che segue. Gli investimenti allineati con altre caratteristiche E/S (#1B) rappresentano la differenza tra la quota effettiva di investimenti allineati con caratteristiche ambientali o sociali (#1) e la quota effettiva di investimenti sostenibili (#1A).

La quota programmata di investimenti riguardanti altri aspetti ambientali rappresenta almeno il 10% e potrebbe modificarsi con l'incremento delle quote effettive di investimenti in linea con la Tassonomia e/o di investimenti socialmente sostenibili.

Monitoraggio, metodologie, fonti di dati e relativi limiti, due diligence e politiche di engagement

Tutti i dati ESG, sia trattati internamente che esternamente, vengono centralizzati dalla *business line* per l'Investimento Responsabile, incaricata del controllo di qualità sui dati ESG in entrata e i dati ESG in uscita, dopo l'elaborazione. Nel monitoraggio sono compresi sia il controllo di qualità automatizzato che il controllo qualitativo svolto da analisti ESG specializzati nel rispettivo settore. I punteggi ESG vengono aggiornati mensilmente attraverso il modulo SRI (Stock Rating Integrator) previsto dalla metodologia esclusiva di Amundi.

Gli indicatori di sostenibilità utilizzati in Amundi si basano su metodologie esclusive. Tali indicatori sono resi costantemente disponibili nel sistema di gestione del portafoglio permettendo ai gestori di valutare l'impatto delle proprie decisioni di investimento.

Inoltre questi indicatori sono incorporati nel sistema di controllo di Amundi, con responsabilità ripartite tra il primo livello di controllo, eseguito dagli stessi team di Investimento, e il secondo livello di controllo, eseguito dai team del Rischio, i quali monitorano in via continuativa il rispetto delle caratteristiche promosse dal fondo.

Il Rating ESG di Amundi, utilizzato per stabilire il punteggio ESG, consiste in un punteggio quantitativo espresso in sette gradi, che vanno da A (universo dei punteggi migliori) a G (punteggi peggiori). Nella scala di Rating ESG di Amundi, i titoli che rientrano nella lista di esclusione corrispondono al grado G. Per gli emittenti *corporate*, la performance ESG è valutata, a livello complessivo e a livello dei singoli criteri rilevanti, mediante il raffronto con il rendimento medio del settore di appartenenza, attraverso la combinazione fra le tre dimensioni ESG.

La metodologia applicata nel rating ESG di Amundi utilizza 38 criteri, sia generali (comuni a tutte le aziende, qualunque sia il loro settore di attività) che settoriali specifici, ponderati per settore e presi in considerazione per il loro impatto su reputazione, efficienza operativa e regolamentazione con riferimento all'emittente. I rating ESG di Amundi possono essere espressi globalmente sulle tre dimensioni E, S e G, o singolarmente, su ciascuno dei fattori ambientali o sociali.

I punteggi ESG di Amundi sono costruiti utilizzando il sistema di analisi e la metodologia di valutazione ESG di Amundi. I dati provengono dalle seguenti fonti di dati ESG: Moody, ISS-Oekom, MSCI e Sustainalytics. Le limitazioni alla nostra metodologia sono strutturalmente correlate all'uso di dati ESG. Il panorama riguardante i dati ESG è attualmente in fase di normalizzazione, cosa che può influire sulla qualità dei dati. Anche la copertura dei dati costituisce un limite. La regolamentazione, sia attuale che futura, miglioreranno l'armonizzazione della reportistica e le informative societarie alla base dei dati ESG.

Siamo consapevoli di queste limitazioni di cui mitigiamo gli effetti grazie alla combinazione di diversi approcci.

Ogni mese, il punteggio ESG viene ricalcolato in base alla metodologia quantitativa di Amundi. Il risultato del calcolo è poi riesaminato dagli analisti ESG che eseguono una verifica qualitativa "a campione" sul settore di riferimento fondata su vari controlli.

Amundi instaura politiche di *engagement* a livello degli emittenti, con le imprese beneficiarie -sia

attuali che potenziali- degli investimenti, indipendentemente dalla tipologia di titoli in portafoglio (azioni e obbligazioni).