

# Amundi

## Zusammengefasster Tätigkeitsbericht für die Teilsondervermögen Amundi MDAX ESG II UCITS ETF, Amundi DivDAX II UCITS ETF, Amundi TecDAX UCITS ETF, Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF und Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF

### Anlageziele und -politik:

Das Anlageziel des jeweiligen Teilfonds besteht darin, den Anlegern einen Ertrag zukommen zu lassen, der an die Wertentwicklung des jeweiligen "Index" dieses Teilfonds anknüpft:

Amundi MDAX ESG II UCITS ETF - Wertentwicklung des MDAX® ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index)

Amundi DivDAX II UCITS ETF - Wertentwicklung des DivDAX® (Performance-Index)

Amundi TecDAX UCITS ETF - Wertentwicklung des TecDAX® (Performance-Index)

Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF - Wertentwicklung des STOXX® Europe 600 ESG+ Net Return Index

Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF - Wertentwicklung des DAX® 50 ESG+ Net Return EUR (Net-Performance-Index)

Es kann keine Zusicherung gegeben werden, dass das Anlageziel des Teilfonds tatsächlich erreicht wird.

Bei der Anknüpfung an die Wertentwicklung des zugrundeliegenden Index kann es zu einem voraussichtlichen Tracking Error kommen.

Eine detaillierte Darstellung der Anlageziele und -politik kann dem Verkaufsprospekt entnommen werden.

### Wesentliche Trends im Berichtszeitraum:

#### Q3 2023

Die Aktienmärkte fielen im dritten Quartal. Trotz guter Unternehmensergebnisse führte der restriktive Ton der Währungshüter zu einem starken Anstieg der langfristigen Zinsen, was wiederum eine Kurskorrektur an den Börsen auslöste. Die 10-jährigen US-Zinsen stiegen in diesem Quartal um fast 75 Basispunkte. Der MSCI World AC sank um -2,9 %.

Auf regionaler Ebene schnitten die Vereinigten Staaten (-3,4 %) schlechter ab als Europa (-2,5 %). Innerhalb der Eurozone (-4,6 %) übertraf Italien (+0,6 %) deutlich seine Nachbarn. Die übrigen Mitgliedsländer waren in diesem Quartal im Minus; Portugal (-6,1 %) und die Niederlande (-11,5 %) bildeten das Schlusslicht. Außerhalb der Eurozone verzeichnete der britische Markt einen Zuwachs von +1,3 %. Sowohl Schweden (-5,1 %) als auch die Schweiz (-3,3 %) beendeten das Quartal im negativen Bereich. Japan (+0,8 %) profitierte in lokaler Währung weiterhin von der Yen-Abwertung und der Resilienz seiner Wirtschaft. Der MSCI Emerging Markets Index (-2,2 %) entwickelte sich negativ, was auf die Underperformance des chinesischen Marktes (-3 %) zurückzuführen war.

Was die europäischen Sektoren angeht, so lag Energie an der Spitze (+14,1 %), gefolgt von Immobilien (+7,9 %) und Banken (+4,1 %). Zyklische Konsumgüter (-11,5 %) und Informationstechnologie (-10,7 %) waren in diesem Quartal die größten Verlierer. Die Performance der Value-Titel (+1,8 %) überstieg außerdem die der Growth-Aktien (-6,5 %).

#### Q4 2023

Die Aktienkurse gingen im Oktober zurück, erlebten dann allerdings vor dem Hintergrund fallender langfristiger Zinsen eine sehr starke Erholung. Im Quartalsverlauf legte der MSCI World AC um +9 % zu. Auf regionaler Ebene übertrafen die Vereinigten Staaten (+11,5 %) Europa (+5,3 %).

Innerhalb der Eurozone (+7,5 %) waren die Kurszuwächse der Niederlande (+14,8 %) und von Portugal (+10,2 %) größer als die ihrer Nachbarn. Die übrigen Mitgliedsländer lagen im grünen Bereich, wobei Frankreich (+5,6 %) und Spanien (+6,7 %) das Schlussfeld anführten.

Außerhalb der Eurozone befand sich Schweden (+12,2 %) mit Abstand an der Spitze, gefolgt von Großbritannien (+1,6 %) und der Schweiz (+1,3 %). Japan (+2,1 %) profitierte in lokaler Währung nach wie vor von der Yen-Abwertung und der Resilienz seiner Wirtschaft. Der MSCI Emerging Markets Index (+5,2 %) war schließlich trotz der Underperformance des chinesischen Marktes (-5 %) positiv.

Die Kursentwicklung der Value-Titel (+3,4 %) lag auf Sektorebene unter der der Growth-Titel (+7,2 %). An der Spitze standen Immobilien (+22,6 %) und IT (+18,3 %), die auf die Zinssätze reagierten. Bei Energie (-4 %) und Basiskonsumgütern handelte es sich um die einzigen Sektoren, die das Quartal negativ abschlossen.

#### Q1 2024

Risikoanlagen begannen das Jahr positiv. Anleger setzten auf eine moderate Verlangsamung, weshalb die Aktienkurse anstiegen. Darüber hinaus stützten gute Quartalsergebnisse der Unternehmen die Aktienmärkte. Davon profitierten wiederum die globalen Aktien, wobei der MSCI ACWI zulegte (+9,1 %). In den Vereinigten Staaten stiegen die Kurse um (+10 %) und waren besser als in Europa (+7,6 %). In der Eurozone (+9,9 %) erzielten die Märkte Zuwächse, die hauptsächlich von den Niederlanden (+17,9 %) und Italien (+15,7 %) getragen wurden. Außerhalb der Eurozone zeigte der britische Markt (2,9 %) in diesem Quartal eine schwächere Performance. Bei den Industrieländern hat Japan (+18,3 %) in diesem Quartal gut abgeschnitten. Die MSCI-Schwellenländer legten zu (+4,0%), vor allem dank der Outperformance Taiwans (+16,9 %).

In Europa überwogen auf Sektorebene die sogenannten zyklischen (+10,4 %) gegenüber den defensiven Werten (+2,9 %). An der Spitze standen Technologie (+17,9 %), zyklische Konsumgüter (+12,3 %) und Versicherungen (+11,9 %). Versorger (-5,6 %) und Immobilien (-1,4 %) zählten in diesem Quartal zu den größten Verlierern. In Europa übertrafen Growth-Werte (+10,7 %) die sogenannten Value-Aktien (+4,4 %).

#### Q2 2024

Nach einer vorübergehenden Korrekturphase im April, ausgelöst durch die Veröffentlichung von US-Inflationszahlen und die daraus resultierenden Zinserhöhungssorgen, erholten sich die Aktienmärkte im weiteren Quartalsverlauf. Beruhigende Quartalsergebnisse trugen maßgeblich zu dieser Erholung bei.

Der MSCI World-Index legte um 2,6 % zu, wobei die regionalen Entwicklungen stark variierten. Der amerikanische Markt (+4,1 %) übertraf dabei Europa (+1,65 %) und Japan (-2,5 %) auf Dollarbasis deutlich. Der nationale politische Kontext löste in Frankreich im Juni einen Kursrückgang von 6 % aus.

Die Gesamtperformance des S & P 500-Index (Total Return) stieg im zweiten Quartal um 4,3 % und allein im Monat Juni um 3,6 %. Das Quartal startete tatsächlich ungünstig, da im April ein Rückgang zu verzeichnen war. Höher als erwartete Inflationsberichte führten zu einem Anstieg der Zinssätze und schürten Befürchtungen vor einer weiteren Zinserhöhung durch die Fed. Die Inflations Sorgen verflüchtigten sich dann und der Aktienmarkt erreichte wieder neue Höchststände.

Wir beobachteten eine Veränderung in der Dynamik der Aktienmärkte, hin zu einer geringeren Konzentration auf die großen amerikanischen Aktien („die glorreichen Sieben“). In bestimmten Phasen zeigte Europa eine Outperformance, da Anleger verstärkt nach weniger teuren Sektoren oder Regionen suchten als in den USA. Die politische Unsicherheit in Frankreich nach der Auflösung der Assemblée nationale führte jedoch zu einem Rückzug der außereuropäischen Anleger. Die große Überraschung war jedoch die Kursrally in China (+5,4 %) nach der Ankündigung zusätzlicher Unterstützung für den Immobiliensektor durch die Behörden, und dies trotz der Gewinnmitnahmen im Juni. Trotz des Anstiegs der langfristigen Zinssätze blieben Growth-Aktien im Vergleich zu Value-Aktien weiterhin deutlich überlegen. Gleichzeitig beobachteten wir ein wachsendes Interesse an zinsensensitiven Sektoren und eine Erholung der europäischen Bankaktien in der ersten Quartalshälfte.

#### **Performance bekannter Aktienindizes:**

MSCI World (USD):	18,37 %
EuroStoxx 50 (EUR):	11,25 %
DAX (EUR):	12,93 %
Topix (JPY):	22,77 %
S & P 500 (USD):	22,70 %

#### **Performance wichtiger Rohstoffe in USD:**

Brent-Rohöl:	+14,59 %
Kupfer:	+17,36 %
Gold:	+21,16 %

Im Berichtszeitraum verlor der Euro gegenüber dem US-Dollar an Wert (-1,80 %), was im Umkehrschluss einen entsprechenden Anstieg des Werts von Anlagen in US-Dollar um denselben Prozentsatz bedeutet. Gegenüber dem japanischen Yen wertete der Euro weiter auf (+9,50 %).

Am 30. Juni 2023 lag die Umlaufrendite 10-jähriger Bundesanleihen bei 2,39 %. Im Berichtszeitraum stieg die Umlaufrendite dieser langfristigen Bundesanleihen um 11 Basispunkte auf +2,50 % zum 28. Juni 2024.

#### **Performance ausgewählter Indizes im Zusammenhang mit den Teilfonds:**

MDAX ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index):	-8,76 %
DivDAX:	6,16 %
TecDAX:	3,85 %
DAX 50 ESG:	13,36 %
STOXX Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index:	14,02 %

#### **Performance der einzelnen Teilfonds (Nettorendite)**

Amundi MDAX ESG II UCITS ETF:	-8,82 %
Amundi DivDAX II UCITS ETF:	+5,21 %
Amundi TecDAX UCITS ETF:	+3,26 %
Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF:	+12,68 %
Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF:	+14,15 %

Quelle: Bloomberg

#### **Wesentliche Risiken der Teilsondervermögen im Berichtszeitraum:**

Neben den allgemeinen Risiken einer Fondsanlage zuzüglich der Risiken einer Anlage in Wertpapierindex-OGAWs (Indexrisiken), bestanden im Berichtszeitraum die folgenden wesentlichen Risiken für die Teilsondervermögen:

##### **Wertveränderungsrisiken:**

Die Vermögensgegenstände, in die die Gesellschaft für Rechnung des jeweiligen Teilfonds investiert, unterliegen Risiken. So können Wertverluste auftreten, indem der Marktwert der Vermögensgegenstände gegenüber dem Einstandspreis fällt oder Kassa- und Terminpreise sich unterschiedlich entwickeln.

##### **Kapitalmarktrisiko:**

Die Kurs- oder Marktwertentwicklung von Finanzprodukten hängt insbesondere von der Entwicklung der Kapitalmärkte ab, die wiederum von der allgemeinen Lage der Weltwirtschaft sowie den wirtschaftlichen und politischen Rahmenbedingungen in den jeweiligen Ländern beeinflusst wird. Auf die allgemeine Kursentwicklung insbesondere an einer Börse können auch irrationale Faktoren wie Stimmungen, Meinungen und Gerüchte einwirken. Schwankungen der Kurs- und Marktwerte können auch auf Veränderungen der Zinssätze, Wechselkurse oder der Bonität eines Emittenten zurückzuführen sein.

##### **Adressenausfallrisiko / Gegenpartei-Risiken (außer zentrale Kontrahenten):**

Durch den Ausfall eines Ausstellers (nachfolgend „Emittent“) oder eines Vertragspartners (Kontrahenten), gegen den der Fonds Ansprüche hat, können für den Teilfonds Verluste entstehen. Das Emittentenrisiko beschreibt die Auswirkung der besonderen Entwicklungen des jeweiligen Emittenten, die neben den allgemeinen Tendenzen der Kapitalmärkte auf den Kurs eines Wertpapiers einwirken. Auch bei sorgfältiger Auswahl der Wertpapiere kann nicht ausgeschlossen werden, dass Verluste durch Vermögensverfall von Emittenten eintreten. Die Partei eines für Rechnung des jeweiligen Teilfonds geschlossenen Vertrags kann teilweise oder vollständig ausfallen (Kontrahentenrisiko). Dies gilt für alle Verträge, die für Rechnung des jeweiligen Teilfonds geschlossen werden.

##### **Kursänderungsrisiko von Aktien:**

Aktien unterliegen erfahrungsgemäß starken Kursschwankungen und somit auch dem Risiko von Kursrückgängen. Diese Kursschwankungen werden insbesondere durch die Entwicklung der Gewinne des emittierenden Unternehmens sowie die Entwicklungen der Branche und der gesamtwirtschaftlichen Entwicklung beeinflusst. Das Vertrauen der Marktteilnehmer in das jeweilige Unternehmen kann die Kursentwicklung ebenfalls beeinflussen. Dies gilt insbesondere bei Unternehmen, deren Aktien erst über einen kürzeren Zeitraum an der Börse oder einem anderen organisierten Markt zugelassen sind; bei diesen können bereits geringe Veränderungen von Prognosen zu starken Kursbewegungen führen. Ist bei einer Aktie der Anteil der frei handelbaren, im Besitz vieler Aktionäre befindlichen Aktien (sogenannter Streubesitz) niedrig, so können bereits kleinere Kauf- und Verkaufsaufträge eine starke Auswirkung auf den Marktpreis haben und damit zu höheren Kursschwankungen führen.

##### **Risiko von negativen Habenzinsen:**

Die Gesellschaft legt liquide Mittel des Teilfonds bei der Verwahrstelle oder anderen Banken für Rechnung des Teilfonds an. Für diese Bankguthaben ist teilweise ein Zinssatz vereinbart, der dem European Interbank Offered Rate (Euribor) abzüglich einer bestimmten Marge entspricht. Sinkt der Euribor unter die vereinbarte Marge, so führt dies zu negativen Zinsen auf dem entsprechenden Konto. Abhängig von der Entwicklung der Zinspolitik der Europäischen Zentralbank können sowohl kurz-, mittel- als auch langfristige Bankguthaben eine negative Verzinsung erzielen.

Eine Darstellung aller mit dem Fonds verbundenen Risiken, kann dem Verkaufsprospekt entnommen werden.

##### **Risikomanagement:**

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisiko-potential wurde für dieses Teilsondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

#### **Wesentliche Veränderungen während und nach dem Berichtszeitraum:**

**Die folgenden Änderungen** traten am 5. Oktober 2023 in Kraft:

- Die von der Gesellschaft verwalteten Teilsondervermögen (die „Teilfonds“) der Umbrella-Konstruktion deutschen Rechts „Lyxor 1“ (ehemals der „Fonds“) wurden in „Amundi“ umbenannt.

Fonds-/Teilfondsbezeichnung alt	Fonds-/Teilfondsbezeichnung neu	ISIN
Lyxor 1	Amundi	
Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF	Amundi MDAX ESG II UCITS ETF	DE000ETF9033
Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF	Amundi DivDax II UCITS ETF	DE000ETF9074
Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF	Amundi TecDAX UCITS ETF	DE000ETF9082
Lyxor 1 STOXX Europe ESG (DR) UCITS ETF	Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF	DE000ETF9603
Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF	Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF	DE000ETF9090

- Derivateinsatz bei den Teilsondervermögen:

Der Einsatz von Derivaten und Finanzinstrumenten mit derivativer Komponente (die „Derivate“) für die oben genannten Teilfonds soll in den BABen konkreter beschrieben werden, damit die Investoren besser informiert sind, in welchen Situationen ein Derivateinsatz benötigt wird. Derzeit ist der Derivateinsatz gemäß § 10 der AABen zulässig, wird aber durch § 3 Abs. 2 der BABen auf den Einsatz in Sondersituationen ((a) Liquiditätsengpässe bei einzelnen Wertpapieren oder (b) besondere Kapitalmaßnahmen oder ähnliches.) im Interesse der Investoren beschränkt, wobei der Wert der eingesetzten derivativen Finanzinstrumente 10 Prozent des jeweiligen Teilfonds nicht übersteigen darf. Die Beschreibung der Sondersituationen, in denen Derivate eingesetzt werden können, wird in den BABen um die folgenden Unterpunkte „effizienteres Cash Management“ und „genauere Abbildung des zugrunde liegenden Index oder ähnliches“ ergänzt und somit lautet § 3 Abs. 2 nach Inkrafttreten der Änderungen:

„Derivate gemäß § 10 der AABen dürfen nur in folgenden Sondersituationen im Interesse der Investoren zum Einsatz kommen, wobei der Wert der eingesetzten derivativen Finanzinstrumente 10 Prozent des Teilfonds nicht übersteigen darf:

- Liquiditätsengpässe bei einzelnen Werten,
- spezielle Kapitalmaßnahmen
- effizienteres Cash Management,
- genauere Abbildung des zugrunde liegenden Index oder ähnliches.“

Die Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) hat die Namensänderungen in den Anlagebedingungen und die Ergänzung der Beschreibung des Derivateinsatzes in den Absätzen 2 des § 3 der BABen der jeweiligen Teilfonds genehmigt.

**Die folgenden Änderungen** traten am 23 Juli 2024 in Kraft:

Der STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index, der dem Teilfonds Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF zugrunde liegt, wurde durch den STOXX® Europe 600 ESG+ EUR Net Return ersetzt und der dem Teilfonds Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF zugrunde liegende DAX 50 ESG Index wurde durch den DAX® 50 ESG+ Net Return EUR ersetzt.

**Ukraine / Russland Konflikt:**

Im Februar 2022 verhängten mehrere Länder (darunter die USA, das Vereinigte Königreich und die EU), aufgrund der offiziellen Anerkennung der Volksrepubliken Donezk und Lugansk durch die Russische Föderation, Sanktionen gegenüber bestimmten Organisationen, Gesellschaften und Personen in Russland. Nach den von Russland am 24. Februar 2022 eingeleiteten Militäroperationen gegen die Ukraine wurden mögliche weitere Sanktionen angekündigt.

Diese Situation hat zusammen mit den zunehmenden Turbulenzen aufgrund von Schwankungen der Rohstoffpreise und der Wechselkurse und dem Potenzial sich negativ auf die Weltwirtschaft auszuwirken zu einem starken Anstieg der Volatilität an den Märkten geführt. Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft erachtet diese Ereignisse für den Fonds als wertbegründend und sieht demnach keine Anpassung des Jahresabschlusses vor.

Im Berichtszeitraum wurden keine direkten Investitionen in Unternehmen in Russland oder der Ukraine getätigt.

**ARUG II:**

Zum 01. Januar 2020 ist das ARUG II in Kraft getreten.

Die Angaben nach §134c Abs. 4 AktG, die nicht im Tätigkeitsbericht oder Anhang angegeben werden, können auf der Homepage der Amundi Luxembourg S.A. unter folgendem Link abgerufen werden:

(<https://www.amundi.lu/retail/Local-Content/Footer/Quick-Links/Regulatory-information/Amundi>)

## Wesentliche Gewinne und Verluste

Amundi DivDAX II UCITS ETF :

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Deutsche Telekom AG).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Vonovia SE).

Amundi MDAX ESG II UCITS ETF :

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position AIXTRON SE).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position SMA Solar Technology AG).

Amundi TecDAX UCITS ETF :

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Sartorius AG).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position ADTRAN Holdings Inc.).

Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF :

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position CRH Plc).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position DSM-Firmenich AG).

Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF) :

Die wesentlichen Gewinne resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position SAP SE).

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Bayer AG).

# Amundi DivDax II UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 30.Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>62.422.529,45</b>	<b>100,06</b>
1 Aktien		62.189.177,94	99,69
- Banken	4.122.419,79		6,61
- Bau und Baustoffe	1.817.117,76		2,91
- Chemische Industrie	5.590.740,05		8,96
- Energieversorger	3.448.961,42		5,53
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	16.816.198,77		26,96
- Pharmaindustrie / Biotech	3.592.771,34		5,76
- Real Estate	2.581.881,30		4,14
- Telekommunikation	6.456.859,12		10,35
- Transportation	5.218.458,89		8,37
- Versicherungen	12.543.769,50		20,11
2 Derivate		290,50	0,00
3. Bankguthaben		216.431,11	0,35
4. Sonstige Vermögensgegenstände		16.629,9	0,03
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-38.572,66</b>	<b>-0,06</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>62.383.956,79</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

# Amundi DivDax II UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondersvermögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Inland</b>									
DE0008404005	Allianz SE		STK	24.173	1.906	6.883	EUR 259,500	6.272.893,50	10,06
DE000BASF111	BASF SE		STK	123.730	16.347	20.126	EUR 45,185	5.590.740,05	8,96
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	136.193	28.814	9.837	EUR 26,380	3.592.771,34	5,76
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	41.345	7.942	9.324	EUR 88,380	3.654.071,10	5,86
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG		STK	79.848	90.378	10.530	EUR 37,170	2.967.950,16	4,76
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	276.524	341.257	64.733	EUR 14,908	4.122.419,79	6,61
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	138.091	32.385	28.332	EUR 37,790	5.218.458,89	8,37
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	274.994	295.291	343.204	EUR 23,480	6.456.859,12	10,35
DE000ENAG999	E.ON SE		STK	281.433	56.768	60.763	EUR 12,255	3.448.961,42	5,53
DE0006047004	Heidelberg Materials AG		STK	18.768	3.603	4.515	EUR 96,820	1.817.117,76	2,91
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG		STK	97.339	30.938	17.015	EUR 64,570	6.285.179,23	10,07
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	13.428	1.145	6.203	EUR 467,000	6.270.876,00	10,05
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	21.228	2.952	4.661	EUR 42,210	896.033,88	1,44
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	28.586	5.404	6.277	EUR 105,400	3.012.964,40	4,83
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	97.246	21.327	21.180	EUR 26,550	2.581.881,30	4,14
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR 62.189.177,94</b>	<b>99,69</b>
<b>Derivate</b>								<b>EUR 290,50</b>	<b>0,00</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-123,00	0,00
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 5				220,00	0,00
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				39,00	0,00
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				40,50	0,00
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 3				114,00	0,00
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>									
<b>EUR-Guthaben bei:</b>								<b>EUR 216.431,11</b>	<b>0,35</b>
Verwahrstelle			EUR	216.431,11			% 100,000	216.431,11	0,35
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>								<b>EUR 16.629,90</b>	<b>0,03</b>
Initial Margin			EUR	14.746,40				14.746,40	0,02
Variation Margin			EUR	1.883,50				1.883,50	0,00
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>								<b>EUR -38.572,66</b>	<b>-0,06</b>
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-38.572,66				-38.572,66	-0,06
<b>Wert des Teilsondersvermögens</b>								<b>EUR 62.383.956,79</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>								<b>EUR 188,67</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>								<b>STK 330.650</b>	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

Die Vermögensgegenstände des Teilsondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2024

Keine Fremdwährungskurse

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:**  
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzurordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE0005439004	Continental AG	STK	0	15.431	
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK	67.019	67.019	
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA	STK	0	23.262	
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
<b>Gekaufte Kontrakte</b> (Basiswert(e): DAX INDEX-Future)					

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	<b>insgesamt EUR</b>	<b>insgesamt EUR</b>	<b>je Anteil <sup>1)</sup> EUR</b>
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		3.061.192,32	9,258
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		185,94	0,001
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		2.314,52	0,007
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-414.265,41	-1,253
5. Sonstige Erträge		7,50	0,000
davon: Sonstiges	7,50		0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>2.649.434,87</b>	<b>8,013</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-0,06	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-150.362,12	-0,455
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-150.362,18</b>	<b>-0,455</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>2.499.072,69</b>	<b>7,558</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		3.677.334,85	11,122
2. Realisierte Verluste		-1.120.544,20	-3,389
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>2.556.790,65</b>	<b>7,733</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>5.055.863,34</b>	<b>15,291</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-129.769,94	-0,392
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-1.713.195,22	-5,181
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-1.842.965,16</b>	<b>-5,574</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>3.212.898,18</b>	<b>9,717</b>

**Entwicklung des Teils Sondervermögens**

	<b>EUR</b>	<b>2023 / 2024 EUR</b>
<b>I. Wert des Teils Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		61.784.106,22
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-3.090.109,00
2. Mittelzufluss (netto)		476.533,18
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	2.091.968,32	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.615.435,14	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		528,21
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		3.212.898,18
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-129.769,94	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-1.713.195,22	
<b>II. Wert des Teils Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>62.383.956,79</b>

**Verwendung der Erträge des Teils Sondervermögens**

	<b>insgesamt EUR</b>	<b>insgesamt EUR</b>	<b>je Anteil <sup>1)</sup> EUR</b>
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>13.465.548,06</b>	<b>40,724</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		8.409.684,72	25,434
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		5.055.863,34	15,291
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>10.965.834,06</b>	<b>33,164</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		1.608.240,55	4,864
2. Vortrag auf neue Rechnung		9.357.593,51	28,301
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>2.499.714,00</b>	<b>7,560</b>
1. Endausschüttung		2.499.714,00	7,560

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

<b>Geschäftsjahr</b>	<b>Teils Sondervermöge am Ende des Geschäftsjahres EUR</b>	<b>Anteilwert EUR</b>
2023/2024	62.383.956,79	188,67
2022/2023	61.784.106,22	189,14
2021/2022	42.874.805,30	159,59
2020/2021	46.522.692,09	195,10

# Amundi DivDax II UCITS ETF

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR **290,50**  
Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte DAX INDEX herangezogen.

### Vertragspartner der derivativen Geschäfte

BNP Paribas S.A.

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

### Sonstige Angaben

#### Amundi DivDAX II UCITS ETF

International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9033

#### Anteilwert

EUR

188,67

#### Umlaufende Anteile

STK

330.650

Anleger

Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

5,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

5,00

Mindeststückelung

Anteil

1,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

0,25

Ertragsverwendung

ausschüttend

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**

**99,69**

**Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)**

**0,00**

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände

zum Nennwert

Verbindlichkeiten

zum Rückzahlungsbetrag

### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

#### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

Gutschrift bezahlter CSDR-Gebühren

EUR

7,50

#### Gesamtkostenquote (in %) gem. § 101 (2) Nr. 1 KAGB

**0,25**

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsondervermögens aus.

#### Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendererstattungen, mit denen das jeweilige Teilsondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

#### An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

##### Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)

EUR

**151.562,91**

Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft

%

68,33

Davon für die Verwahrstelle

%

22,52

Davon für Dritte

%

9,15

#### Transaktionskosten

EUR

**1.481,30**

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Amundi Luxembourg S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

### Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)

0,50%

Höhe der Annual Tracking Difference

-0,94%

Der im Geschäftsjahr 2023/2024 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error.

### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

### Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

### Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Amundi Luxembourg S.A. gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

**Offenlegung gemäß Art. 7 Offenlegungsverordnung:**

Während des Berichtszeitraums beachtete die Gesellschaft für den Teilfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („Principal Adverse Impacts“ = PAI) dergestalt, dass der Indikator Nummer 14 „Engagement in umstrittene Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)“ des Anhangs 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 im Rahmen der Investitionsentscheidungen berücksichtigt wurde. Dies erfolgte über die normative Ausschlusspolitik der Amundi-Gruppe; konkret: Vermögensgegenstände (i) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf oder der Lagerung von chemischen, biologischen und abgereicherten Uranwaffen beteiligt sind sowie (ii) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf, der Lagerung oder der Erbringung von Dienstleistungen für bzw. von Antipersonenminen und Streubomben, die nach den Verträgen von Ottawa und Oslo verboten sind, beteiligt sind, waren zum Erwerb für den Teilfonds ausgeschlossen.

**Erklärung gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852 vom 18. Juni 2020 (Taxonomie):**

Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

**Angaben zur Vergütung gemäß § 101 (4) 1.-5. KAGB:**

VERGÜTUNGSRICHTLINIEN UND VERGÜTUNGSPRAXIS

Die Vergütungsrichtlinie von Amundi Luxembourg S.A. steht im Einklang mit den Anforderungen der am 18. März 2016 in Kraft getretenen Europäischen Verordnung 2014/91/EU, die im Luxemburger Gesetz vom 10. Mai 2016 umgesetzt wurden.

Die Vergütungsrichtlinie basiert auf der Rahmenordnung für Vergütungen der Unternehmensgruppe Amundi und wird jährlich vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg S.A. überprüft und genehmigt. Die Richtlinie unterliegt einer jährlichen unabhängigen Prüfung durch den internen Compliance-Bereich die, jeweils im vierten Quartal durchgeführt wird. In den wichtigsten Entwicklungen des Jahres 2023 wurde die Vergütungspolitik mit der "Amundi Ambition 2025" verknüpft und daher wurden ESG-Kriterien und Nachhaltigkeitsrisiken hinzugefügt. Es gab keine weiteren wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik der Vorjahre. Die für 2023 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 05. Oktober 2023 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2023 fand am 02. Februar 2023 statt. Die Ziele der Vergütungsrichtlinie und der Vergütungspraktiken stehen im Einklang mit einem fundierten und wirksamen Risikomanagement und unterstützen dies, indem sie die Vergütung an langfristigen Ergebnissen und Risiken ausrichten, um Interessenkonflikte zu vermeiden. Die Festvergütung steht in Zusammenhang mit den übernommenen Aufgaben, den erbrachten professionellen Dienstleistungen und dem Verantwortungsbereich und reflektiert den Grad der akademischen Ausbildung, das marktübliche Gehaltsniveau, die Erfahrung und die Kompetenzen, die für einzelne Positionen erforderlich sind, sowie das gezeigte Leistungsniveau. Die variable Vergütung soll eine nachhaltige langfristige Entwicklung der Verwaltungsgesellschaft und ein solides und wirksames System des Risikomanagements fördern. Bei der Zuerkennung einer variablen Vergütung wird die Leistung des Mitarbeiters, seines Geschäftsbereichs und der gesamten Amundi Group berücksichtigt und sie basiert sowohl auf finanziellen als auch auf nicht-finanziellen Kriterien. Amundi Luxembourg S.A. und die Unternehmensgruppe Amundi haben das gesamte identifizierte Personal definiert, das Befugnisse über die von Amundi verwalteten Fonds hat oder diese beeinflussen kann und das somit wahrscheinlich auf die Wertentwicklung oder das Risikoprofil unserer Fonds einwirken kann.

HÖHE DER ZUERKANNTEN VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft Amundi Luxembourg S.A. ist zum 31.12.2023 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Geschäftsjahrs 2023 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	110	8,737,726.50	1,545,780.42	10,283,506.92
Davon				
Ermittelte Mitarbeiter	9	1,419,514.99	516,082.67	1,935,597.66
Alle sonstigen Mitarbeiter	101	7,318,211.51	1,029,697.75	8,347,909.26

Die oben genannten Zahlen der Gesamtvergütung beziehen sich auf Aktivitäten im Hinblick auf alle verwalteten Fonds. Mitarbeiter von Amundi Luxembourg S.A. und der Unternehmensgruppe Amundi, die in den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berufen werden, verzichten bezüglich aller verwalteten Fonds auf jegliche Vergütungsansprüche. Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft erhalten keine Beträge, die direkt vom OGAW oder AIF gezahlt werden, auch keine Gewinnbeteiligung und Performancegebühren.

VERGÜTUNG DES AUSLAGERUNGSUNTERNEHMENS

Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi.

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 18,278 EUR, davon 8,833 EUR in der festen Vergütung und 9,445 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 103,681 EUR, davon 72,673 EUR in der festen Vergütung und 31,008 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2023 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1,923 Mitarbeiter von denen 100 Mitarbeiter identifiziert staff (\*) waren.

(\*) Geschäftsleitung der Gesellschaft, Mitarbeiter deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Verwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen haben, sowie bestimmte weitere Mitarbeiter („risikorelevante Mitarbeiter“ oder „Risktaker“)

Luxemburg, den 02.Oktober.2024

Amundi Luxembourg S.A

# Amundi MDAX ESG II UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>107.602.021,54</b>	<b>100,08</b>
1. Aktien		106.631.347,92	99,18
- Bau und Baustoffe	1.716.546,60		1,60
- Bergbau	4.205.117,68		3,91
- Büroausstattung	4.959.865,24		4,61
- Chemische Industrie	10.767.086,93		10,01
- Einzelhandel	6.318.928,81		5,88
- Elektrik / Elektronik	1.180.771,60		1,10
- Energieversorger	1.738.642,62		1,62
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	15.933.104,90		14,82
- Papier- und Verpackungsindustrie	3.124.946,80		2,91
- Pharmaindustrie / Biotech	10.627.390,72		9,88
- Real Estate	9.249.600,96		8,60
- Software	1.394.662,45		1,30
- Sonstige Dienstleistungen	4.014.473,48		3,73
- Sonstige industrielle Werte	4.616.888,90		4,29
- Telekommunikation	9.672.805,36		9,00
- Textilien und Kleidung	4.433.315,31		4,12
- Transportation	5.688.707,41		5,29
- Unterhaltungsindustrie	1.835.719,20		1,71
- Verbrauchsgüter	766.772,80		0,71
- Versicherungen	4.386.000,15		4,08
2. Derivate		1.169,00	0,00
3. Bankguthaben		902.157,53	0,84
4. Sonstige Vermögensgegenstände		67.347,09	0,06
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-88.234,42</b>	<b>-0,08</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>107.513.787,12</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

# Amundi MDAX ESG II UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondersvermögens	
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Aktien</b>										
<b>Inland</b>										
DE0006766504	Aurubis AG		STK	30.829	9.269	10.533	EUR 73,250	2.258.224,25	2,10	
DE0005158703	Bechtle AG		STK	82.195	23.431	28.342	EUR 43,940	3.611.648,30	3,36	
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	35.796	10.431	13.516	EUR 65,650	2.350.007,40	2,19	
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	996.271	291.843	376.537	EUR 5,710	5.688.707,41	5,29	
DE0006095003	ENCAVIS AG		STK	19.943	32.014	140.508	EUR 16,900	337.036,70	0,31	
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	244.107	89.643	63.677	EUR 19,050	4.650.238,35	4,33	
DE0005664809	Evotec SE		STK	145.544	42.378	54.087	EUR 8,975	1.306.257,40	1,21	
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG		STK	35.613	10.360	13.350	EUR 48,200	1.716.546,60	1,60	
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG		STK	116.463	34.005	44.040	EUR 24,800	2.888.282,40	2,69	
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	194.942	58.860	75.657	EUR 35,760	6.971.125,92	6,48	
DE0006602006	GEA Group AG		STK	153.944	54.355	55.529	EUR 38,900	5.988.421,60	5,57	
DE000A0LD6E6	Gerrresheimer AG		STK	31.156	9.431	10.859	EUR 100,300	3.124.946,80	2,91	
DE000A13SX22	HELLA GmbH & Co. KGaA		STK	20.036	5.837	7.564	EUR 85,500	1.713.078,00	1,59	
DE000A161408	HelloFresh SE		STK	169.640	51.482	55.632	EUR 4,520	766.772,80	0,71	
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG		STK	58.303	16.658	20.206	EUR 41,770	2.435.316,31	2,27	
DE000A2NB601	JENOPTIK AG		STK	49.897	62.795	12.898	EUR 27,020	1.348.216,94	1,25	
DE0006219934	Jungheinrich AG		STK	47.016	13.699	17.750	EUR 30,760	1.446.212,16	1,35	
DE000KSA6888	K+S Aktiengesellschaft		STK	175.428	50.694	78.896	EUR 12,575	2.206.007,10	2,05	
DE000KGX8881	KION GROUP AG		STK	68.726	20.003	25.814	EUR 39,090	2.686.499,34	2,50	
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	64.753	18.904	24.483	EUR 71,300	4.616.888,90	4,29	
DE0006335003	KRONES AG		STK	13.025	16.731	19.786	EUR 117,200	1.526.530,00	1,42	
DE0005470405	LANXESS AG		STK	84.576	32.788	30.549	EUR 22,980	1.943.556,48	1,81	
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	72.590	21.193	27.448	EUR 76,260	5.535.713,40	5,15	
DE000A0D6554	Nordex SE		STK	122.518	35.698	46.255	EUR 11,440	1.401.605,92	1,30	
DE0006969603	PUMA SE		STK	103.413	33.519	37.278	EUR 42,870	4.433.315,31	4,12	
DE0007010803	RATIONAL AG		STK	4.995	4.995	0	EUR 777,500	3.883.612,50	3,61	
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	73.462	20.706	26.334	EUR 71,200	5.230.494,40	4,86	
DE000WAF3001	Sitronic AG		STK	16.309	21.605	5.296	EUR 72,400	1.180.771,60	1,10	
DE000STAB1L8	Stabilus SE		STK	24.194	7.633	9.717	EUR 42,750	1.034.293,50	0,96	
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA		STK	30.672	9.833	12.195	EUR 59,850	1.835.719,20	1,71	
DE0008303504	TAG Immobilien AG		STK	171.891	50.086	64.897	EUR 13,670	2.349.749,97	2,19	
DE000TLX1005	Talanx AG		STK	58.833	23.344	21.492	EUR 74,550	4.386.000,15	4,08	
DE000A2YN900	TeamViewer AG		STK	133.142	50.127	61.167	EUR 10,475	1.394.662,45	1,30	
DE0007500001	thyssenkrupp AG		STK	482.143	151.394	192.939	EUR 4,038	1.946.893,43	1,81	
DE000TRAT0N7	TRATON SE		STK	50.346	50.346	0	EUR 30,550	1.538.070,30	1,43	
DE000TUAG505	TUI AG		STK	443.000	443.000	0	EUR 6,604	2.925.572,00	2,72	
DE0005089031	United Internet AG		STK	77.238	104.017	26.779	EUR 20,120	1.554.028,56	1,45	
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG		STK	19.325	7.122	6.157	EUR 101,800	1.967.285,00	1,83	
							<b>EUR</b>	<b>104.178.308,85</b>	<b>96,90</b>	
<b>Ausland</b>										
LU1673108939	Aroundtown SA		STK	694.041	872.660	178.619	EUR 1,966	1.364.137,59	1,27	
LU1704650164	BEFESA S.A.		STK	35.058	47.465	50.486	EUR 31,060	1.088.901,48	1,01	
							EUR	2.453.039,07	2,28	
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>								<b>EUR</b>	<b>106.631.347,92</b>	<b>99,18</b>
<b>Derivate</b>										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									<b>1.169,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Aktienindex-Derivate</b>										
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>										
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>										
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-124,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 9				364,50	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				32,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-123,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 19				722,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 5				220,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-123,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 8				312,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				39,50	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-27,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-124,00	0,00	
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>902.157,53</b>	<b>0,84</b>	
<b>EUR-Guthaben bei:</b>										
Verwahrstelle		EUR		902.175,64		% 100,000		902.175,64	0,84	
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>67.347,09</b>	<b>0,06</b>	
Initial Margin		EUR		64.349,70				64.349,70	0,06	
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR		733,85				733,85	0,00	
Variation Margin		EUR		2.263,54				2.263,54	0,00	
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-18,11</b>	<b>-0,00</b>	
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
Verwahrstelle		USD		-19,40		% 100,000		-18,11	0,00	
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-88.234,42</b>	<b>-0,08</b>	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR		-88.234,42				-88.234,42	-0,08	
<b>Wert des Teilsondersvermögens</b>							<b>EUR</b>	<b>107.513.787,12</b>	<b>100,00</b> <sup>1)</sup>	
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>128,21</b>		
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>838.572</b>		

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

Die Vermögensgegenstände des Teilsondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2024

**Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.06.2024**

US-Dollar (USD) 1,07175 = 1 EUR

**Marktschlüssel**

**Terminbörsen**

EUREX European Exchange

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:**

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE	STK	18.481	138.152	
DE0005565204	Dürr AG	STK	7.990	59.740	
DE0006632003	MorphoSys AG	STK	42.100	42.100	
DE0006452907	Nemetschek SE	STK	16.071	82.856	
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	STK	22.650	171.698	
DE000A0DJ6J9	SMA Solar Technology AG	STK	7.052	27.046	
DE000A2GS401	Software AG	STK	0	50.268	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	147.532	1.077.930	
DE000VTSC017	Vitesco Technologies Group AG	STK	22.095	22.095	
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
<b>Gekaufte Kontrakte</b>					
(Basiswert(e): DAX INDEX-Future)					20.246
<b>Verkaufte Kontrakte</b>					
(Basiswert(e): DAX INDEX-Future)					55

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		2.608.735,92	3,111
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		70.262,72	0,084
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		176,09	0,000
4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		6.788,36	0,008
5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-320.786,14	-0,383
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-10.539,42	-0,013
7. Sonstige Erträge		85,49	0,000
davon: Sonstiges	85,49		0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>2.354.723,02</b>	<b>2,808</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-0,15	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-340.297,23	-0,406
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-340.297,38</b>	<b>-0,406</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>2.014.425,64</b>	<b>2,402</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		5.230.488,90	6,237
2. Realisierte Verluste		-8.229.712,55	-9,814
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-2.999.223,65</b>	<b>-3,577</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-984.798,01</b>	<b>-1,174</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-4.689.831,24	-5,593
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-3.717.889,55	-4,434
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-8.407.720,79</b>	<b>-10,026</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-9.392.518,80</b>	<b>-11,201</b>

**Entwicklung des Teilsondervermögens**

	2023 / 2024
	EUR
<b>I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>129.151.549,56</b>
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-2.264.486,11
2. Mittelzufluss (netto)	-9.792.894,86
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	21.417.378,50
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-31.210.273,36
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-187.862,67
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	-9.392.518,80
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-4.689.831,24
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-3.717.889,55
<b>II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>107.513.787,12</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>2.012.572,80</b>	<b>2,400</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		0,00	0,000
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-984.798,01	-1,174
3. Zuführung aus dem Sondervermögen <sup>2)</sup>		2.997.370,81	3,574
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>0,00</b>	<b>0,000</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		0,00	0,000
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>2.012.572,80</b>	<b>2,400</b>
1. Endausschüttung		2.012.572,80	2,400

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

2) Die Zuführung aus dem Sondervermögen dient dem Ausgleich von im Geschäftsjahr realisierten Verluste, die damit bei der Berechnung der Ausschüttung unberücksichtigt bleiben; im Ergebnis kann sich damit für das laufende oder für künftige Geschäftsjahre eine Substanzausschüttung im investimentrechtlichen Sinne ergeben.

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsondervermög am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2023/2024	107.513.787,12	128,21
2022/2023	129.151.549,56	143,32
2021/2022	102.396.533,53	135,48
2020/2021	227.873.639,99	180,69

# Amundi MDAX ESG II UCITS ETF

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR **1.169,00**  
 Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte DAX INDEX herangezogen.

Vertragspartner der derivativen Geschäfte  
 BNP Paribas S.A.

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

### Sonstige Angaben

#### Amundi MDAX ESG II UCITS ETF

<b>International Security Identification Number (ISIN)</b>		<b>DE000ETF9074</b>
<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>128,21</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>838.572</b>
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Mindeststückelung	Anteil	1,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,20
Ertragsverwendung		ausschüttend

<b>Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>99,18</b>
<b>Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)</b>	<b>0,00</b>

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

#### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

Gutschrift bezahlten CSDR-Gebühren	EUR	97,84
------------------------------------	-----	-------

#### Gesamtkostenquote (in %)

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teilsondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teilsondervermögens aus.

**0,30**

### Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendungserstattungen, mit denen das jeweilige Teilsondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teilsondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

### An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

<b>Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)</b>	<b>EUR</b>	<b>373.422,82</b>
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	74,74
Davon für die Verwahrstelle	%	17,63
Davon für Dritte	%	7,63
	EUR	

### Transaktionskosten

**7.962,77**

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Amundi Luxembourg S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teilsondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

### Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teilsondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,16%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,06%

Der im Geschäftsjahr 2023/2024 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error.

### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

### Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamttrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

### Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Amundi Luxembourg S.A. gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

**Offenlegung gemäß Art. 7 Offenlegungsverordnung:**

Während des Berichtszeitraums beachtete die Gesellschaft für den Teilfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („Principal Adverse Impacts“ = PAI) dergestalt, dass der Indikator Nummer 14 „Engagement in umstrittene Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)“ des Anhangs 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 im Rahmen der Investitionsentscheidungen berücksichtigt wurde. Dies erfolgte über die normative Ausschlusspolitik der Amundi-Gruppe; konkret: Vermögensgegenstände (i) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf oder der Lagerung von chemischen, biologischen und abgereicherten Uranwaffen beteiligt sind sowie (ii) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf, der Lagerung oder der Erbringung von Dienstleistungen für bzw. von Antipersonenminen und Streubomben, die nach den Verträgen von Ottawa und Oslo verboten sind, beteiligt sind, waren zum Erwerb für den Teilfonds ausgeschlossen.

Die Darstellung der offenzulegenden Informationen für regelmäßige Berichte für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 sowie im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 kann im hinteren Teil des Berichts entnommen werden.

**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 **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, Verfahrenweisen 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?

**Ja**    **Nein**

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: \_\_\_\_\_

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: \_\_\_\_\_

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es 70,20 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

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 ISS-ESG. Die MDAX® ESG+ (NR) EUR verfolgt die Performance des MDAX® Index, wobei ESG-Ausschlussfilter und Bewertungsmethoden der ISS-ESG verwendet werden, um mindestens 20 Prozent der Unternehmen aus dem MDAX® auszuschließen.

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 ISS-ESG auch das ESG-Rating des Portfolios darstellt. Der ESG-Score des MDAX® ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index) des Datenanbieters ISS-ESG am Ende des Zeitraums betrug:

	ISS-ESG Punktzahl	ISS-ESG Daten Abdeckung
<b>MDAX ESG+</b>	<b>54,71</b>	<b>100%</b>

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

Am Ende des vorherigen Zeitraums der ESG-Score des MDAX® ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index) des Datenanbieters ISS-ESG betrug **52,31**.

● **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 dem oben genannten Ziel 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 (Principle 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 sektorbezogen), der Integration von ESG-Ratings in den Anlageprozess, Engagement und Abstimmungsansätzen:

- **Ausschluss:** Amundi Group hat normative, tätigkeitsbasierte und sektorbasierte 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?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 01.07.2023 bis 30.06.2024**

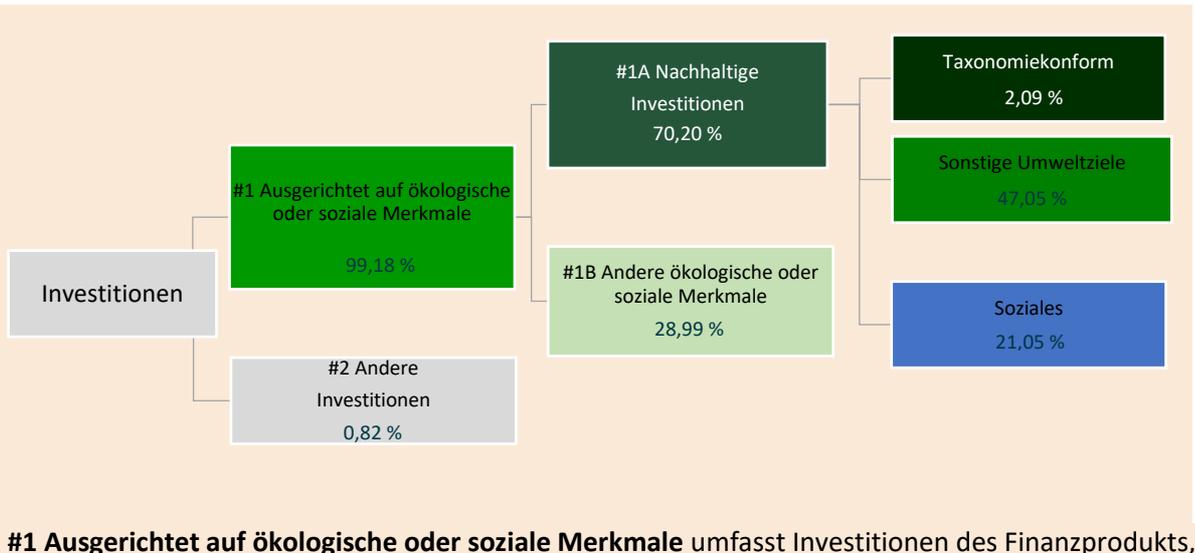
Größte Investitionen	Sektor	TeilSektor	Land	In % der Vermögenswerte
FRESEN MED CARE AG	Gesundheit	Gesundheits-Dienstleistungen und -Ausrüstung	Deutschland	6,48 %
GEA GROUP AG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	5,57 %
DEUTSCHE LUFT-HANSA	Industrie	Verkehr	Deutschland	5,29 %
LEG IMMOBILIEN AG	Immobilien	Immobilienverwaltung und -entwicklung	Deutschland	5,15 %
SCOUT24 SE	Kommunikationsdienste	Medien & Unterhaltung	Deutschland	4,87 %
EVONIK INDUSTRIES AG	Grundstoffe	Chemikalien	Deutschland	4,33 %
KNORR-BREME AG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	4,29 %
PUMA SE	Zyklische Konsumgüter	Langlebige Konsumgüter und Kleidung	Deutschland	4,12 %
TALANX AG	Finanzwesen	Versicherungen	Deutschland	4,08 %
RATIONAL AG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	3,61 %
BECHTLE AG	IT	IT-Software und -Services	Deutschland	3,36 %
GERRESHEIMER AG (XETRA)	Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	Deutschland	2,91 %
TUI AG XETRA	Zyklische Konsumgüter	Verbraucherservice	Deutschland	2,72 %
FREENET AG	Kommunikationsdienste	Telekommunikationsdienste	Deutschland	2,69 %
KION GROUP AG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	2,50 %

Die Daten in der obigen Tabelle basieren auf einem einzelnen Portfolio-Beobachtungspunkt zum Berichtszeitpunkt 28. Juni 2024.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die für diesen Bericht verwendeten Daten des Emittenten zur Anpassung an die EU-Taxonomie sind verspätet und beziehen sich noch auf das Jahr 2022. Aktuellere Daten waren zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Jahresberichtes noch nicht verfügbar.

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

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

<b><i>Sektor</i></b>	<b><i>Teilsektor</i></b>	<b><i>In % der Vermögenswerte</i></b>
<i>Industrie</i>	<i>Investitionsgüter</i>	<i>22,44 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Chemikalien</i>	<i>10,02 %</i>
<i>Gesundheit</i>	<i>Gesundheits-Dienstleistungen und -Ausrüstung</i>	<i>8,67 %</i>
<i>Immobilien</i>	<i>Immobilienverwaltung und -entwicklung</i>	<i>8,60 %</i>
<i>Industrie</i>	<i>Verkehr</i>	<i>6,89 %</i>
<i>Kommunikationsdienste</i>	<i>Medien &amp; Unterhaltung</i>	<i>6,57 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Langlebige Konsumgüter und Kleidung</i>	<i>6,39 %</i>
<i>IT</i>	<i>IT-Software und -Services</i>	<i>4,66 %</i>
<i>Kommunikationsdienste</i>	<i>Telekommunikationsdienste</i>	<i>4,13 %</i>
<i>Gesundheit</i>	<i>Pharma Biotech &amp; Life Sciences</i>	<i>4,12 %</i>
<i>Finanzwesen</i>	<i>Versicherungen</i>	<i>4,08 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Metalle &amp; Bergbau</i>	<i>3,91 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Verbraucherservice</i>	<i>2,72 %</i>

Zyklische Konsumgüter	Automobile & Komponenten	1,59 %
IT	Hardware und Ausrüstung	1,25 %
IT	Halbleiter & Halbleiterausrüstung	1,10 %
Industrie	Professionelle Dienste	1,01 %
Nicht-zyklische Konsumgüter	Consumer Staples Distribution & Retail	0,71 %
Öffentliche Dienstleistungen	Unabhängige Erzeuger von Strom und erneuerbarer Energie	0,31 %
Sonstige	Sonstige	0,00 %
Liquide Mittel	Liquide Mittel	0,82 %

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die 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.



### 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 2,09 % 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.

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

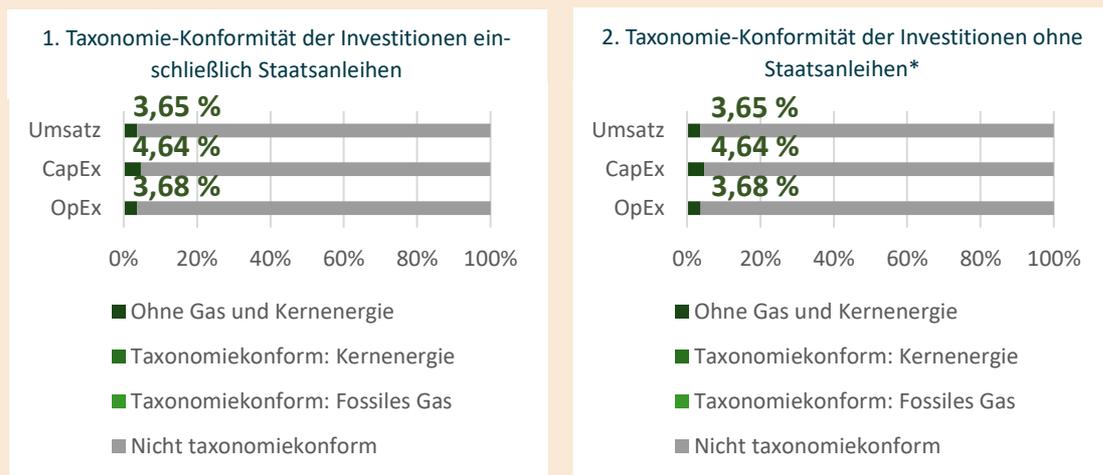
Nein

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<sup>2</sup>) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen siehe

Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxoniekonforme 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, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopapieremissionen von Staaten.

Die für diesen Bericht verwendeten Daten des Emittenten zur Anpassung an die EU-Taxonomie beziehen sich noch auf das Jahr 2022. Aktuellere Daten waren zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Jahresberichtes noch nicht verfügbar.

**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 CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

Zum 30.06.2024 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 0,00 % und der Anteil der Investitionen an ermöglichenden Tätigkeiten betrug 0,64 %.

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

Am Ende des vorherigen Zeitraums betrug der Prozentsatz der Investitionen mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden 1,99%.



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



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

Der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit nicht an der Taxonomie ausgerichteten Umweltzielen lag am Ende des Berichtszeitraums bei **47,05 %**.

Der Anteil von **47,05 %** 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 **21,05 %**.



### 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. Für Anleihen und Aktien ohne Rating gelten Mindeststandards für Umwelt- und Sozialschutz durch Kontroversenprüfung anhand der Grundsätze des UN Global Compact.



### 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 ISS-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.

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren.

- **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 Bewertungsmethodik des ESG-Bereichs des Datenanbieters International Shareholder Services Inc. verwendet, um mindestens 20 Prozent der Unternehmen des MDAX® auszuschließen.

	ISS-ESG Punktzahl	ISS-ESG Daten Abdeckung
<b>MDAX ESG+</b>	54,71	100%
<b>MDAX Index</b>	49,85	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 entsprachen insgesamt denjenigen des Indexes.

	ISS-ESG Punktzahl	ISS-ESG Daten Abdeckung
<b>MDAX ESG+</b>	54,71	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
	30/06/2024
<b>Amundi MDAX ESG II UCITS ETF</b>	-8,82%
<b>MDAX ESG+</b>	-8,76%
<b>Spread</b>	-0,06%

- **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
	30/06/2024
<b>Amundi MDAX ESG II UCITS ETF</b>	- 8,82%
<b>MDAX Index</b>	- 8,82%
<b>Spread</b>	0,00%

## Angaben zur Vergütung gemäß § 101 (4) 1.-5. KAGB:

### VERGÜTUNGSRICHTLINIEN UND VERGÜTUNGSPRAXIS

Die Vergütungsrichtlinie von Amundi Luxembourg S.A. steht im Einklang mit den Anforderungen der am 18. März 2016 in Kraft getretenen Europäischen Verordnung 2014/91/EU, die im Luxemburger Gesetz vom 10. Mai 2016 umgesetzt wurden.

Die Vergütungsrichtlinie basiert auf der Rahmenordnung für Vergütungen der Unternehmensgruppe Amundi und wird jährlich vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg S.A. überprüft und genehmigt. Die Richtlinie unterliegt einer jährlichen unabhängigen Prüfung durch den internen Compliance-Bereich die, jeweils im vierten Quartal durchgeführt wird. In den wichtigsten Entwicklungen des Jahres 2023 wurde die Vergütungspolitik mit der "Amundi Ambition 2025" verknüpft und daher wurden ESG-Kriterien und Nachhaltigkeitsrisiken hinzugefügt. Es gab keine weiteren wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik der Vorjahre. Die für 2023 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 05. Oktober 2023 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2023 fand am 02. Februar 2023 statt. Die Ziele der Vergütungsrichtlinie und der Vergütungspraktiken stehen im Einklang mit einem fundierten und wirksamen Risikomanagement und unterstützen dies, indem sie die Vergütung an langfristigen Ergebnissen und Risiken ausrichten, um Interessenkonflikte zu vermeiden. Die Festvergütung steht in Zusammenhang mit den übernommenen Aufgaben, den erbrachten professionellen Dienstleistungen und dem Verantwortungsbereich und reflektiert den Grad der akademischen Ausbildung, das marktübliche Gehaltsniveau, die Erfahrung und die Kompetenzen, die für einzelne Positionen erforderlich sind, sowie das gezeigte Leistungsniveau. Die variable Vergütung soll eine nachhaltige langfristige Entwicklung der Verwaltungsgesellschaft und ein solides und wirksames System des Risikomanagements fördern. Bei der Zuerkennung einer variablen Vergütung wird die Leistung des Mitarbeiters, seines Geschäftsbereichs und der gesamten Amundi Group berücksichtigt und sie basiert sowohl auf finanziellen als auch auf nicht-finanziellen Kriterien.

Amundi Luxembourg S.A. und die Unternehmensgruppe Amundi haben das gesamte identifizierte Personal definiert, das Befugnisse über die von Amundi verwalteten Fonds hat oder diese beeinflussen kann und das somit wahrscheinlich auf die Wertentwicklung oder das Risikoprofil unserer Fonds einwirken kann.

### HÖHE DER ZUERKANNTEN VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft Amundi Luxembourg S.A. ist zum 31.12.2023 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Geschäftsjahrs 2023 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	110	8,737,726.50	1,545,780.42	10,283,506.92
Davon				
Ermittelte Mitarbeiter	9	1,419,514.99	516,082.67	1,935,597.66
Alle sonstigen Mitarbeiter	101	7,318,211.51	1,029,697.75	8,347,909.26

Die oben genannten Zahlen der Gesamtvergütung beziehen sich auf Aktivitäten im Hinblick auf alle verwalteten Fonds. Mitarbeiter von Amundi Luxembourg S.A. und der Unternehmensgruppe Amundi, die in den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berufen werden, verzichten bezüglich aller verwalteten Fonds auf jegliche Vergütungsansprüche.

Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft erhalten keine Beträge, die direkt vom OGAW oder AIF gezahlt werden, auch keine Gewinnbeteiligung und Performancegebühren.

### VERGÜTUNG DES AUSLAGERUNGSUNTERNEHMENS

Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi.

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 18,278 EUR, davon 8,833 EUR in der festen Vergütung und 9,445 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 103,681 EUR, davon 72,673 EUR in der festen Vergütung und 31,008 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2023 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1,923 Mitarbeiter von denen 100 Mitarbeiter identifiziert staff (\*) waren.

(\*) Geschäftsleitung der Gesellschaft, Mitarbeiter deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Verwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen haben, sowie bestimmte weitere Mitarbeiter („risikorelevante Mitarbeiter“ oder „Risktaker“)

Luxemburg, den 02. Oktober 2024

Amundi Luxembourg S.A

# Amundi TecDAX UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>80.920.312,77</b>	<b>100,10</b>
1 Aktien		80.618.547,70	99,73
- Büroausstattung	5.091.608,06		6,30
- Elektrik / Elektronik	19.978.824,31		24,71
- Energieversorger	1.651.015,76		2,04
- Pharmaindustrie / Biotech	18.929.009,53		23,42
- Software	18.640.833,66		23,06
- Telekommunikation	16.327.256,38		20,20
2 Derivate		-1.212,00	0,00
3. Bankguthaben		276.948,73	0,34
4. Sonstige Vermögensgegenstände		26.028,34	0,03
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-81.958,12</b>	<b>-0,10</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>80.838.354,65</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

# Amundi TecDAX UCITS ETF

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2024

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2024	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsongersvermögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Inland</b>									
DE000545503	1&1 AG	STK		25.915	38.917	13.002	EUR 15,940	413.085,10	0,51
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE	STK		76.700	20.507	47.927	EUR 18,335	1.406.294,50	1,74
DE0005104400	ATOSS Software AG	STK		5.329	8.659	7.008	EUR 112,000	596.848,00	0,74
DE0005158703	Bechtle AG	STK		56.746	16.248	35.291	EUR 43,940	2.493.419,24	3,08
DE0005419105	CANCOM SE	STK		21.916	4.448	18.489	EUR 32,260	707.010,16	0,87
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		24.713	6.623	15.728	EUR 65,650	1.622.408,45	2,01
DE000A288904	CompuGroup Medical SE & Co.KGaA	STK		18.154	4.687	9.979	EUR 23,800	432.065,20	0,53
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		547.159	282.750	228.679	EUR 23,480	12.847.293,32	15,89
DE0005659700	Eckert & Ziegler Str.-u.Med.AG	STK		9.855	10.546	13.846	EUR 45,860	451.950,30	0,56
DE0005677108	Elmos Semiconductor SE	STK		4.985	4.985	0	EUR 76,100	379.358,50	0,47
DE0005313506	Energiekontor AG	STK		4.645	7.302	2.657	EUR 62,600	290.777,00	0,36
DE0005664809	Evotec SE	STK		100.501	27.130	63.407	EUR 8,975	901.996,48	1,12
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG	STK		80.404	21.582	51.245	EUR 24,800	1.994.019,20	2,47
DE000HAG0005	HENSOLDT AG	STK		40.677	10.080	17.772	EUR 34,340	1.396.848,18	1,73
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		325.006	205.269	134.000	EUR 34,305	11.149.330,83	13,79
DE000A2NB601	JENOPTIK AG	STK		34.448	9.223	21.908	EUR 27,020	930.784,96	1,15
DE000A3H2200	Nagarro SE	STK		5.306	1.298	3.044	EUR 75,900	402.725,40	0,50
DE0006452907	Nemetschek SE	STK		38.349	9.806	29.560	EUR 91,850	3.522.355,65	4,36
DE000A0D6554	Nordex SE	STK		84.584	22.707	53.827	EUR 11,440	967.640,96	1,20
DE000A0JBPG2	PNE AG	STK		28.910	46.993	18.083	EUR 13,580	392.597,80	0,49
DE0007164600	SAP SE	STK		69.263	24.692	30.668	EUR 189,520	13.126.723,76	16,24
DE0007165631	Sartorius AG	STK		17.054	4.519	10.234	EUR 219,000	3.734.826,00	4,62
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	STK		188.026	64.487	53.509	EUR 53,800	10.115.798,80	12,51
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK		11.259	2.244	6.387	EUR 72,400	815.151,60	1,01
DE000A0DJ6J9	SMA Solar Technology AG	STK		13.720	5.001	8.665	EUR 26,360	361.659,20	0,45
DE000A1K0235	SÜSS MicroTec SE	STK		11.957	12.664	707	EUR 61,500	735.355,50	0,91
DE000A2YN900	TeamViewer AG	STK		91.918	31.262	64.705	EUR 10,475	962.841,05	1,19
DE0005089031	United Internet AG	STK		53.323	14.332	33.951	EUR 20,120	1.072.858,76	1,33
							<b>EUR</b>	<b>74.224.023,90</b>	<b>91,82</b>
<b>Ausland</b>									
AT0000A0E9W5	Kontron AG	STK		29.015	9.599	16.181	EUR 19,220	557.668,30	0,69
NL0015001WV6	Qiagen N.V.	STK		151.410	227.269	75.859	EUR 38,550	5.836.855,50	7,22
							<b>EUR</b>	<b>6.394.523,80</b>	<b>7,91</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>80.618.547,70</b>	<b>99,73</b>
<b>Derivate</b>								<b>-1.212,00</b>	<b>0,00</b>
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 5				-505,00	0,00
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-101,00	0,00
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 5				-505,00	0,00
DAX INDEX 20/09/2024		EUREX	EUR	Anzahl 1				-101,00	0,00
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>							<b>EUR</b>	<b>276.948,73</b>	<b>0,34</b>
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle		EUR		276.968,28			% 100,000	276.968,28	0,34
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>							<b>EUR</b>	<b>26.028,34</b>	<b>0,03</b>
Dividendenansprüche		EUR		418,84				418,84	0,00
Initial Margin		EUR		16.087,00				16.087,00	0,02
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR		6.102,50				6.102,50	0,01
Variation Margin		EUR		3.420,00				3.420,00	0,00
<b>Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme</b>							<b>EUR</b>	<b>-19,55</b>	<b>0,00</b>
<b>Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Verwahrstelle		USD		-20,94			% 100,000	-19,55	0,00
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>							<b>EUR</b>	<b>-81.958,12</b>	<b>-0,10</b>
Verbindlichkeiten	Verwaltungsvergütung	EUR		-81.958,12				-81.958,12	-0,10
<b>Wert des Teilsongersvermögens</b>							<b>EUR</b>	<b>80.838.354,65</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>24,55</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>3.293.456</b>	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Teilsongersvermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2024

### Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.06.2024

US-Dollar (USD) 1,07175 = 1 EUR

**Marktschlüssel****Terminbörsen**

EUREX European Exchange

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:**

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE0006632003	MorphoSys AG	STK	3.937	35.545	
DE000A2GS401	Software AG	STK	0	43.706	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	31.082	840.030	
DE000A0JL9W6	VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG	STK	1.836	19.368	
<b>Ausland</b>					
US00486H1059	ADTRAN Holdings Inc.	STK	8.074	75.023	
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	0	211.041	
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
<b>Gekaufte Kontrakte</b> (Basiswert(e): DAX INDEX-Future)					
					1.532

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		1.215.666,03	0,369
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		18.002,67	0,005
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		180,25	0,000
4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		5.123,42	0,002
5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-92.307,72	-0,028
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-3.441,49	-0,001
7. Sonstige Erträge		36,72	0,000
davon: Sonstiges	36,72		0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>1.143.259,88</b>	<b>0,347</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-99,37	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-315.697,13	-0,096
3. Sonstige Aufwendungen		-17.176,89	-0,005
davon: Sonstiges	-17.176,89		-0,005
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-332.973,39</b>	<b>-0,101</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>810.286,49</b>	<b>0,246</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		7.073.766,80	2,148
2. Realisierte Verluste		-5.301.747,83	-1,610
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>1.772.018,97</b>	<b>0,538</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>2.582.305,46</b>	<b>0,784</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-2.333.532,19	-0,709
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.511.824,70	0,763
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>178.292,51</b>	<b>0,054</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>2.760.597,97</b>	<b>0,838</b>

**Entwicklung des Teilsondervermögens**

	2023 / 2024
	EUR
<b>I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	EUR
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	92.777.144,88
2. Mittelzufluss (netto)	-1.538.231,52
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	2.005.179,04
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-15.274.993,26
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	108.657,54
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	2.760.597,97
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	-2.333.532,19
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	2.511.824,70
<b>II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>80.838.354,65</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>14.549.307,20</b>	<b>4,418</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		11.967.001,74	3,634
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.582.305,46	0,784
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>13.725.943,20</b>	<b>4,168</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		1.600.190,01	0,486
2. Vortrag auf neue Rechnung		12.125.753,19	3,682
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>823.364,00</b>	<b>0,250</b>
1. Endausschüttung		823.364,00	0,250

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsondervermö am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2023/2024	80.838.354,65	24,55
2022/2023	92.777.144,88	24,22
2021/2022	83.457.957,79	22,18
2020/2021	95.674.210,48	27,69

# Amundi TecDAX UCITS ETF

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure EUR -1.212,00  
Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte DAX INDEX herangezogen.

### Vertragspartner der derivativen Geschäfte

BNP Paribas S.A.

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

### Sonstige Angaben

#### Amundi TecDAX UCITS ETF

#### International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert	EUR	24,55	DE000ETF9082
Umlaufende Anteile	STK	3.293.456	
Anleger			Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00	
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00	
Mindeststückelung	Anteil	1,00	
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,40	
Ertragsverwendung			ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %) 99,73

Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %) 0,00

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

#### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

Gutschrift bezahlten CSDR Gebühren EUR 38,19

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Rückstellung Wirecard für Dividende EUR -19.101,40

#### Gesamtkostenquote (in %)

0,40

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teils Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teils Sondervermögens aus.

### Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teils Sondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendungsleistungen, mit denen das jeweilige Teils Sondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teils Sondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

### An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	344.395,91
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	81,07
Davon für die Verwahrstelle	%	13,20
Davon für Dritte	%	5,73

### Transaktionskosten

EUR

2.791,48

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Amundi Luxembourg S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teils Sondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teils Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

### Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teils Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)

0,10%

Höhe der Annual Tracking Difference

-0,59%

Der im Geschäftsjahr 2023/2024 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error.

### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

### Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

### Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Amundi Luxembourg S.A. gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

### Offenlegung gemäß Art. 7 Offenlegungsverordnung:

Während des Berichtszeitraums beachtete die Gesellschaft für den Teilfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („Principal Adverse Impacts“ = PAI) dergestalt, dass der Indikator Nummer 14 „Engagement in umstrittene Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)“ des Anhangs 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 im Rahmen der Investitionsentscheidungen berücksichtigt wurde. Dies erfolgte über die normative Ausschlusspolitik der Amundi-Gruppe; konkret: Vermögensgegenstände (i) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf oder der Lagerung von chemischen, biologischen und abgereicherten Uranwaffen beteiligt sind sowie (ii) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf, der Lagerung oder der Erbringung von Dienstleistungen für bzw. von Antipersonenminen und Streubomben, die nach den Verträgen von Ottawa und Oslo verboten sind, beteiligt sind, waren zum Erwerb für den Teilfonds ausgeschlossen.

Erklärung gemäß Artikel 7 der Verordnung (EU) 2020/852 vom 18. Juni 2020 (Taxonomie):  
 Die diesem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

**Angaben zur Vergütung gemäß § 101 (4) 1.-5. KAGB:**

VERGÜTUNGSRICHTLINIEN UND VERGÜTUNGSPRAXIS

Die Vergütungsrichtlinie von Amundi Luxembourg S.A. steht im Einklang mit den Anforderungen der am 18. März 2016 in Kraft getretenen Europäischen Verordnung 2014/91/EU, die im Luxemburger Gesetz vom 10. Mai 2016 umgesetzt wurden.

Die Vergütungsrichtlinie basiert auf der Rahmenordnung für Vergütungen der Unternehmensgruppe Amundi und wird jährlich vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg S.A. überprüft und genehmigt. Die Richtlinie unterliegt einer jährlichen unabhängigen Prüfung durch den internen Compliance-Bereich die, jeweils im vierten Quartal durchgeführt wird. In den wichtigsten Entwicklungen des Jahres 2023 wurde die Vergütungspolitik mit der "Amundi Ambition 2025" verknüpft und daher wurden ESG-Kriterien und Nachhaltigkeitsrisiken hinzugefügt. Es gab keine weiteren wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik der Vorjahre. Die für 2023 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 05. Oktober 2023 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2023 fand am 02. Februar 2023 statt. Die Ziele der Vergütungsrichtlinie und der Vergütungspraktiken stehen im Einklang mit einem fundierten und wirksamen Risikomanagement und unterstützen dies, indem sie die Vergütung an langfristigen Ergebnissen und Risiken ausrichten, um Interessenkonflikte zu vermeiden. Die Festvergütung steht in Zusammenhang mit den übernommenen Aufgaben, den erbrachten professionellen Dienstleistungen und dem Verantwortungsbereich und reflektiert den Grad der akademischen Ausbildung, das marktübliche Gehaltsniveau, die Erfahrung und die Kompetenzen, die für einzelne Positionen erforderlich sind, sowie das gezeigte Leistungsniveau. Die variable Vergütung soll eine nachhaltige langfristige Entwicklung der Verwaltungsgesellschaft und ein solides und wirksames System des Risikomanagements fördern. Bei der Zuerkennung einer variablen Vergütung wird die Leistung des Mitarbeiters, seines Geschäftsbereichs und der gesamten Amundi Group berücksichtigt und sie basiert sowohl auf finanziellen als auch auf nicht-finanziellen Kriterien.

Amundi Luxembourg S.A. und die Unternehmensgruppe Amundi haben das gesamte identifizierte Personal definiert, das Befugnisse über die von Amundi verwalteten Fonds hat oder diese beeinflussen kann und das somit wahrscheinlich auf die Wertentwicklung oder das Risikoprofil unserer Fonds einwirken kann.

HÖHE DER ZUERKANNTEN VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft Amundi Luxembourg S.A. ist zum 31.12.2023 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Geschäftsjahrs 2023 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	110	8,737,726.50	1,545,780.42	10,283,506.92
Davon				
Ermittelte Mitarbeiter	9	1,419,514.99	516,082.67	1,935,597.66
Alle sonstigen Mitarbeiter	101	7,318,211.51	1,029,697.75	8,347,909.26

Die oben genannten Zahlen der Gesamtvergütung beziehen sich auf Aktivitäten im Hinblick auf alle verwalteten Fonds. Mitarbeiter von Amundi Luxembourg S.A. und der Unternehmensgruppe Amundi, die in den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berufen werden, verzichten bezüglich aller verwalteten Fonds auf jegliche Vergütungsansprüche.

Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft erhalten keine Beträge, die direkt vom OGAW oder AIF gezahlt werden, auch keine Gewinnbeteiligung und Performancegebühren.

VERGÜTUNG DES AUSLAGERUNGSUNTERNEHMENS

Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi.

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 18,278 EUR, davon 8,833 EUR in der festen Vergütung und 9,445 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 103,681 EUR, davon 72,673 EUR in der festen Vergütung und 31,008 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2023 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1,923 Mitarbeiter von denen 100 Mitarbeiter identifiziert staff (\*) waren.

(\*) Geschäftsleitung der Gesellschaft, Mitarbeiter deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Verwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen haben, sowie bestimmte weitere Mitarbeiter („risikorelevante Mitarbeiter“ oder „Risktaker“)

Luxemburg, den 02.Oktober.2024

Amundi Luxembourg S.A

# Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>60.021.667,01</b>	<b>100,05</b>
1 Aktien		59.415.406,83	99,04
- Aeronautik und Weltraum	80.475,60		0,13
- Audiovisuelle Industrie	219.746,99		0,37
- Banken	7.293.514,94		12,16
- Bau und Baustoffe	2.364.641,82		3,94
- Bergbau	457.314,18		0,76
- Büroausstattung	403.456,13		0,67
- Chemische Industrie	1.519.726,68		2,53
- Einzelhandel	1.406.039,51		2,34
- Elektrik / Elektronik	5.061.565,69		8,44
- Energieversorger	5.541.772,68		9,24
- Freizeit/Tourismus	198.348,61		0,33
- Holdinggesellschaften	50.041,55		0,08
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	3.255.509,25		5,43
- Papier und andere Basisprodukte	231.230,39		0,39
- Papier- und Verpackungsindustrie	199.774,27		0,33
- Pharmaindustrie / Biotech	11.819.403,27		19,70
- Real Estate	747.885,02		1,25
- Software	1.510.221,88		2,52
- Sonstige Dienstleistungen	1.853.276,49		3,09
- Sonstige Finanzdienstleistungen	884.941,29		1,48
- Sonstige industrielle Werte	1.455.631,26		2,43
- Telekommunikation	1.981.118,36		3,30
- Textilien und Kleidung	2.064.045,54		3,44
- Transportation	777.389,62		1,30
- Unterhaltungsindustrie	298.736,96		0,50
- Verbrauchsgüter	4.263.729,87		7,11
- Versicherungen	3.475.868,98		5,79
2 Derivate		-840,00	0,00
3. Bankguthaben		265.961,59	0,44
4. Sonstige Vermögensgegenstände		341.138,59	0,57
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-27.552,30</b>	<b>-0,05</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>59.994.114,71</b>	<b>100 <sup>1)</sup></b>

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.











SE0018012635	Wihlborgs Fastigheter AB	STK	1.633	0	0	SEK	97,900	14.085,52	0,02
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.	STK	1.550	144	184	EUR	154,800	239.940,00	0,40
FR0011981968	Worldline S.A.	STK	1.472	0	0	EUR	10,120	14.896,64	0,02
JE00B8KF9B49	WPP PLC	STK	7.283	1.565	1.507	GBP	7,244	62.225,69	0,10
NO0010208051	Yara International ASA	STK	991	184	278	NOK	307,600	26.712,67	0,04
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	934	86	91	CHF	479,100	464.648,15	0,77
						<b>EUR</b>		<b>50.865.575,44</b>	<b>84,78</b>
<b>Andere Wertpapiere</b>									
<b>Ausland</b>									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	4.450	323	268	CHF	249,500	1.152.873,68	1,92
						<b>EUR</b>		<b>1.152.873,68</b>	<b>1,92</b>
						<b>EUR</b>		<b>59.415.406,83</b>	<b>99,04</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>									
<b>Derivate</b>									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
<b>Aktienindex-Derivate</b>									
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>									
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>									
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/09/2024	EUREX	EUR	Anzahl 1					350,00	0,88
EURO STOXX 50 - FUTURE 20/09/2024	EUREX	EUR	Anzahl 1					-650,00	-1,63
STXE6ESGX EURP 20/09/2024	EUREX	EUR	Anzahl 4					160,00	0,40
STXE6ESGX EURP 20/09/2024	EUREX	EUR	Anzahl 7					-700,00	-1,76
<b>Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>									
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle	EUR		221.273,37			%	100,000	221.273,37	0,37
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
Verwahrstelle	DKK		4.003,35			%	100,000	536,83	0,00
Verwahrstelle	NOK		25.963,45			%	100,000	2.275,20	0,00
Verwahrstelle	PLN		4.205,80			%	100,000	976,16	0,00
Verwahrstelle	SEK		82.329,25			%	100,000	7.316,76	0,01
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Verwahrstelle	CHF		13.690,26			%	100,000	14.215,52	0,02
Verwahrstelle	GBP		15.126,91			%	100,000	17.841,49	0,03
Verwahrstelle	USD		1.703,37			%	100,000	1.589,34	0,00
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Dividendenforderungen Aktien	EUR		9.909,82					9.909,82	0,02
Dividendenforderungen Aktien	GBP		29.141,47					34.371,02	0,06
Dividendenforderungen Aktien	USD		20.844,69					19.449,21	0,03
Dividendenforderungen REITS	GBP		1.275,26					1.504,11	0,00
Initial Margin	EUR		19.836,40					19.836,40	0,03
Quellensteuererstattungsansprüche	CHF		209.756,58					217.804,45	0,36
Quellensteuererstattungsansprüche	DKK		128.618,20					17.246,94	0,03
Quellensteuererstattungsansprüche	EUR		18.927,28					18.927,28	0,03
Quellensteuererstattungsansprüche	PLN		759,51					176,28	0,00
Variation Margin	EUR		1.850,00					1.850,00	0,00
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR		-27.552,30					-27.552,30	-0,05
<b>Wert des Teilsongermögens</b>									
<b>Anteilwert</b>									
<b>Umlaufende Anteile</b>									
						<b>EUR</b>		<b>59.994.114,71</b>	<b>100,00</b> <sup>1)</sup>
						<b>EUR</b>		<b>52,97</b>	
						<b>STK</b>		<b>1.132.702</b>	

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

Die Vermögensgegenstände des Teilsondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2024

**Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.06.2024**

Britisches Pfund	(GBP)	0,84785 = 1 EUR
Dänische Krone	(DKK)	7,45745 = 1 EUR
Norwegische Krone	(NOK)	11,4115 = 1 EUR
Polnischer Zloty	(PLN)	4,3085 = 1 EUR
Schwedische Krone	(SEK)	11,35 = 1 EUR
Schweizer Franken	(CHF)	0,96305 = 1 EUR
US-Dollar	(USD)	1,07175 = 1 EUR

**Marktschlüssel****Terminbörsen**

EUREX European Exchange

**Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:**

Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE	STK	0	858	
DE000BASF111	BASF SE	STK	582	6.276	
DE0006095003	ENCAVIS AG	STK	0	593	
DE0005664809	Evotec SE	STK	0	1.131	
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE	STK	0	869	
DE000A2YN900	TeamViewer AG	STK	816	816	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	0	6.985	
<b>Ausland</b>					
NL0015001C01	Aalberts N.V. - Anrechte	STK	0	504	
NL0015001LT4	ABN AMRO Bank N.V. - Anrechte	STK	2.984	2.984	
ES0167050246	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK	65	65	
ES06670509N0	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte	STK	1.305	1.305	
ES06670509O8	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte	STK	1.370	1.370	
NO0010844038	Adevinta ASA	STK	2.205	2.205	
BE0970183860	Aedifica S.A. - Anrechte	STK	0	302	
NL0000303709	AEGON N.V.	STK	0	9.690	
NL0015001GE6	AEGON N.V. - Anrechte	STK	0	9.690	
NL0015001MH7	AEGON N.V. - Anrechte	STK	9.690	9.690	
FR0000031122	Air France-KLM S.A.	STK	0	11.264	
FR001400J770	Air France-KLM S.A.	STK	1.126	1.126	
FR001400Q9B4	Alstom S.A. - Anrechte	STK	1.835	1.835	
FR001400IKH6	Alstom S.A. - Anrechte	STK	1.816	1.816	
AT0000A18XM4	ams AG	STK	4.444	6.969	
CH1305590544	ams-OSRAM AG - Anrechte	STK	1.617	1.617	
LU1598757687	ArcelorMittal S.A.	STK	456	3.872	
NL0015001S86	ArcelorMittal S.A. - Anrechte	STK	3.369	3.369	
GB0000961622	Balfour Beatty PLC	STK	0	3.516	
SE0000862997	BillerudKorsnäs AB	STK	0	1.823	
DK0010181759	Carlsberg AS	STK	645	645	
DK0060227585	Christian Hansen Holding AS	STK	0	622	
NL0010545661	CNH Industrial N.V.	STK	0	6.240	
ES0105563003	Corporacion Acciona Energias R	STK	0	482	
FR001400P9F6	Covivio S.A. - Anrechte	STK	309	309	
IE0001827041	CRH PLC	STK	405	5.110	
GB0009633180	Dechra Pharmaceuticals PLC	STK	0	684	
CH1216478797	DSM-Firmenich AG	STK	0	1.197	
FR0010908533	Edenred S.A.	STK	0	1.545	
ES0627797915	EDP Renováveis S.A. - Anrechte	STK	2.142	2.142	
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	0	612	
SE0016828511	Embracer Group AB	STK	5.497	5.497	
GB00BG12Y042	Energear PLC	STK	0	1.061	
SE0011166974	Fabege AB	STK	0	1.085	
NL0015001I05	Ferrovial SE - Anrechte	STK	3.249	3.249	
FR0011726835	Gaztransport Technigaz	STK	0	185	
GB00BMBVGQ36	Harbour Energy PLC	STK	0	3.636	
ES06445809R9	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	35.367	35.367	
ES06445809Q1	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	36.863	36.863	
ES0139140174	Inmobiliaria Colonial SOCIMI	STK	0	1.818	
SE0015811963	Investor AB	STK	12	11.665	
SE0007871645	Kindred Group PLC	STK	0	1.376	
SE0015810247	Kinnevik AB	STK	0	1.448	
SE0022060547	Kinnevik AB	STK	1.448	1.448	
SE0022060521	Kinnevik AB	STK	1.448	1.448	
FI4000312251	Kojamo Oyj	STK	0	931	
SE0015949201	Lifco AB	STK	1.389	1.389	
PLLPP0000011	LPP S.A.	STK	0	7	
GB00BKFB1C65	M&G PLC	STK	0	14.864	
FI4000552526	Mandatum OYJ	STK	2.748	2.748	

GB0031274896	Marks & Spencer Group PLC	STK	0	11.908
GB00B1CRLC47	Mondi PLC	STK	0	2.675
GB00BSRK4X90	National Grid PLC	STK	6.756	6.756
GB00BSRK4Y08	National Grid PLC - Anrechte	STK	6.757	6.757
NL0015001LR8	NN Group N.V. - Anrechte	STK	1.549	1.549
NO0003055501	Nordic Semiconductor ASA	STK	0	740
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	10.205	20.332
GB00B3MBS747	Ocado Group PLC	STK	0	3.547
GB0006825383	Persimmon PLC	STK	1.969	1.969
NL0015001W49	Pluxee	STK	481	481
PLPZU0000011	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	STK	1.053	5.171
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	0	1.349
FR0000130395	Rémy Cointreau S.A.	STK	0	138
FI0009003305	Sampo OYJ	STK	2	3.065
CH1243598427	Sandoz Group AG	STK	2.460	2.460
CH0239229302	SFS Group AG	STK	0	156
NL0015001SE1	Shell PLC - Anrechte	STK	40.692	40.692
DK0060495240	SimCorp A/S	STK	0	215
BE0003470755	Solvay S.A.	STK	110	571
GB00BGBN7C04	SSP Group PLC	STK	0	4.984
LU0075646355	Subsea 7 S.A.	STK	0	1.345
DK0062616637	Svitzer Group A/S	STK	60	60
SE0020846285	Swedish Orphan Biovitrum AB - Anrechte	STK	1.132	1.132
BE0974464977	Syensqo N.V.	STK	497	497
LU0156801721	Tenaris S.A.	STK	0	2.921
DK0060477503	Topdanmark AS	STK	0	264
ES0183746090	Vidrala S.A.	STK	7	7
ES06837469B2	Vidrala S.A. - Anrechte	STK	150	150
ES0684262910	Viscofan S.A. - Anrechte	STK	0	228
SE0016844831	Volvo Car AB	STK	0	3.040
SE0021628914	Volvo Car AB	STK	3.040	3.040
GB00BJDQQ870	Watches Of Switzerland Group PLC	STK	0	1.273
GB00B2PDGW16	WH Smith PLC	STK	0	819
NL0015001LH9	Wolters Kluwer N.V. - Anrechte	STK	1.635	1.635

**Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)**

**Terminkontrakte**

**Aktienindex-Terminkontrakte**

**Gekaufte Kontrakte**

(Basiswert(e): EURO STOXX 50 - FUTURE, SMI SWISS MARKET INDEX -Futures, STXE6ESGX EURP)

2.357

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		236.353,35	0,209
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		1.655.087,34	1,461
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		84,94	0,000
4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		4.844,05	0,004
5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-31.937,86	-0,028
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-134.451,30	-0,119
7. Sonstige Erträge		281,45	0,000
davon: Sonstiges	281,45		0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>1.730.261,97</b>	<b>1,528</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-151,14	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-104.783,07	-0,093
3. Sonstige Aufwendungen		-21,97	0,000
davon: Sonstiges	-21,97		0,000
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-104.956,18</b>	<b>-0,093</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>1.625.305,79</b>	<b>1,435</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		1.112.308,15	0,982
2. Realisierte Verluste		-488.748,58	-0,431
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>623.559,57</b>	<b>0,551</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>2.248.865,36</b>	<b>1,985</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		5.637.225,53	4,977
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-453.599,51	-0,400
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>5.183.626,02</b>	<b>4,576</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>7.432.491,38</b>	<b>6,562</b>

**Entwicklung des Teilsondervermögens**

	EUR	EUR
<b>I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		53.036.904,12
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.476.832,00
2. Mittelzufluss (netto)		1.010.494,35
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	1.010.494,35	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	0,00	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		-8.943,14
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		7.432.491,38
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	5.637.225,53	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	-453.599,51	
<b>II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>59.994.114,71</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>8.725.594,71</b>	<b>7,703</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		6.476.729,35	5,718
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.248.865,36	1,985
3. Zuführung aus dem Sondervermögen <sup>2)</sup>		0,00	0,000
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>7.105.830,85</b>	<b>6,273</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		7.105.830,85	6,273
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>1.619.763,86</b>	<b>1,430</b>
1. Endausschüttung		1.619.763,86	1,430

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

2) Die Zuführung aus dem Sondervermögen dient dem Ausgleich von im Geschäftsjahr realisierten Verluste, die damit bei der Berechnung der Ausschüttung unberücksichtigt bleiben; im Ergebnis kann sich damit für das laufende oder für künftige Geschäftsjahre eine Substanzausschüttung im investimentrechtlichen Sinne ergeben.

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsondervermög am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2023/2024	59.994.114,71	52,97
2022/2023	53.036.904,12	47,76
2021/2022	49.565.252,55	41,99
2020/2021	48.961.655,32	46,28

# Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR -840,00  
Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte EURO STOXX 50,STXE 600 ESG-X herangezogen.

**Vertragspartner der derivativen Geschäfte**  
BNP Paribas S.A.

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

### Sonstige Angaben

**Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF**

**International Security Identification Number (ISIN)**

<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>DE000ETF9603</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>52,97</b>
Anleger		<b>1.132.702</b>
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	Private Anleger
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Mindeststückelung	Anteil	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	1,00
Ertragsverwendung		0,19
		ausschüttend

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**

**99,04**

**Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)**

**0,00**

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

#### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

Gutschrift bezahlten CSDR Gebühren	EUR	25,80
QST-Erstattung	EUR	247,43
Erstattung aus ordentlicher Aktionärsversammlung	EUR	6,94

#### Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Aufwendungen setzten sich zusammen aus:

Korrektur Dividendenzahlungen.	EUR	-21,54
--------------------------------	-----	--------

#### Gesamtkostenquote (in %)

**0,19**

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teils Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teils Sondervermögens aus.

#### Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teils Sondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendungsleistungen, mit denen das jeweilige Teils Sondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teils Sondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

#### An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

<b>Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)</b>	<b>EUR</b>	<b>104.069,73</b>
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	34,25
Davon für die Verwahrstelle	%	53,71
Davon für Dritte	%	12,04

#### Transaktionskosten

**EUR**

**9.843,52**

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Amundi Luxembourg S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teils Sondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teils Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

#### Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teils Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

#### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,14%
Höhe der Annual Tracking Difference	0,13%

Der im Geschäftsjahr 2023/2024 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error

#### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

#### Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Amundi Luxembourg S.A. gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

**Offenlegung gemäß Art. 7 Offenlegungsverordnung:**

Während des Berichtszeitraums beachtete die Gesellschaft für den Teilfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („Principal Adverse Impacts“ = PAI) dergestalt, dass der Indikator Nummer 14 „Engagement in umstrittene Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)“ des Anhangs 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 im Rahmen der Investitionsentscheidungen berücksichtigt wurde. Dies erfolgte über die normative Ausschlusspolitik der Amundi-Gruppe; konkret: Vermögensgegenstände (i) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf oder der Lagerung von chemischen, biologischen und abgereicherten Uranwaffen beteiligt sind sowie (ii) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf, der Lagerung oder der Erbringung von Dienstleistungen für bzw. von Antipersonenminen und Streubomben, die nach den Verträgen von Ottawa und Oslo verboten sind, beteiligt sind, waren zum Erwerb für den Teilfonds ausgeschlossen.

Die Darstellung der offenzulegenden Informationen für regelmäßige Berichte für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 sowie im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 kann im hinteren Teil des Berichts entnommen werden.

**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 STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF **Unternehmenskennung (LEI-Code):** 529900WC5GC9BSS8N059

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, Verfahrenweisen 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="radio"/>	<b>Ja</b>	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/>	<b>Nein</b>
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es _____ an nachhaltigen Investitionen <b>70,97 %</b>
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt	<input type="checkbox"/>	



**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 STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index (der "Index"). Das Teilsondervermögen fördert ökologische und/oder soziale Merkmale, einschließlich durch die Integration des Umwelt-, Sozial- und Governance-Ratings ("ESG") des ESG-Bereichs des Datenanbieters Sustainalytics. Der STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index verfolgt die Performance des STOXX® Europe 600 Index Unter Anwendung einer Reihe von Compliance-, Engagement- und ESG-Performance-Screenings, d.h. der Index enthält ca. 480 Indexkomponenten, wobei die "fehlenden" 120 Aktien aus dem Investmentuniversum des STOXX® Europe 600 Index aufgrund der ESG-Kriterien nicht ausgewählt wurden. Der STOXX®Europa 600 Index umfasst die 600 größten Aktien ausgewählter europäischer Länder.

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Das Teilsondervermögen replizierte kontinuierlich den STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index, dessen ESG-Rating des Datenanbieters Sustainalytics auch das ESG-Rating des Portfolios ist. Der ESG-Score des STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index des Datenanbieters Sustainalytics zum Ende des Berichtszeitraums betrug:

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>STOXX Europe 600 ESG+</b>	<b>76,22</b>	<b>99,79%</b>

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

Am Ende des vorherigen Zeitraums der ESG-Score des STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index des Datenanbieters Sustainalytics betrug **75,15**.

● **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 dem oben genannten Ziel 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 (Principle 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?**

Das 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 sektorbezogen), der Integration von ESG-Ratings in den Anlageprozess, Engagement und Abstimmungsansätzen:

- **Ausschluss:** Amundi Group hat normative, tätigkeitsbasierte und sektorbasierte 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?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 01.07.2023 bis 30.06.2024**

Größte Investitionen	Sektor	TeilSektor	Land	In % der Vermögenswerte
NOVO NORDISK A/S-B	Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	Dänemark	4,57 %
ASML HOLDING NV	IT	Halbleiter & Halbleiterausrüstung	Niederlande	4,07 %
NESTLE SA-REG	Nicht-zyklische Konsumgüter	Lebensmittel, Getränke & Tabak	Schweiz	2,64 %
ASTRAZENECA GBP	Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	Vereinigtes Königreich	2,38 %
SHELL PLC	Energie	Öl, Gas und Verbrauchsbrennstoffe	Vereinigtes Königreich	2,26 %
NOVARTIS AG-REG	Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	Schweiz	2,14 %
SAP SE / XETRA	IT	IT-Software und -Services	Deutschland	2,05 %
ROCHE HLDG AG-GENUSS	Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	Schweiz	1,93 %
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	Zyklische Konsumgüter	Langlebige Konsumgüter und Kleidung	Frankreich	1,93 %
HSBC HOLDING PLC GBP	Finanzwesen	Banken	Vereinigtes Königreich	1,60 %
TOTALENERGIES SE PARIS	Energie	Öl, Gas und Verbrauchsbrennstoffe	Frankreich	1,57 %
SIEMENS AG-REG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	1,39 %
UNILEVER PLC (GBP)	Nicht-zyklische Konsumgüter	Körperpflegeprodukte	Vereinigtes Königreich	1,36 %
SCHNEIDER	Industrie	Investitionsgüter	Frankreich	1,35 %

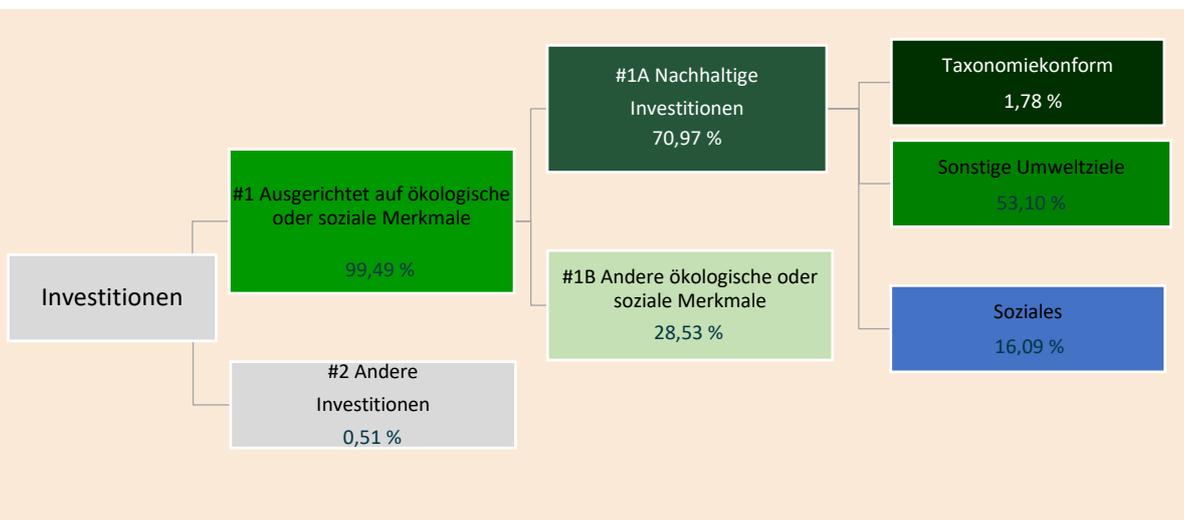
ELECT SE				
SANOFI	Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	Frankreich	1,09 %

Die Daten in der obigen Tabelle basieren auf einem einzelnen Portfolio-Beobachtungspunkt zum Berichtszeitpunkt 28, Juni 2024.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die für diesen Bericht verwendeten Daten des Emittenten zur Anpassung an die EU-Taxonomie sind verspätet und beziehen sich noch auf das Jahr 2022. Aktuellere Daten waren zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Jahresberichtes noch nicht verfügbar.

### In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	14,37 %
Industrie	Investitionsgüter	11,33 %
Finanzwesen	Banken	9,87 %

<i>Energie</i>	<i>Öl, Gas und Verbrauchsbrennstoffe</i>	<i>6,02 %</i>
<i>Finanzwesen</i>	<i>Versicherungen</i>	<i>5,88 %</i>
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	<i>Lebensmittel, Getränke &amp; Tabak</i>	<i>5,77 %</i>
<i>IT</i>	<i>Halbleiter &amp; Halbleiterausüstung</i>	<i>5,30 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Langlebige Konsumgüter und Kleidung</i>	<i>4,16 %</i>
<i>Finanzwesen</i>	<i>Finanzdienstleistungen</i>	<i>3,97 %</i>
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	<i>Körperpflegeprodukte</i>	<i>3,53 %</i>
<i>IT</i>	<i>IT-Software und -Services</i>	<i>3,04 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Chemikalien</i>	<i>2,86 %</i>
<i>Industrie</i>	<i>Professionelle Dienste</i>	<i>2,53 %</i>
<i>Gesundheit</i>	<i>Gesundheits-Dienstleistungen und -Ausrüstung</i>	<i>2,53 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Automobile &amp; Komponenten</i>	<i>2,52 %</i>
<i>Kommunikationsdienste</i>	<i>Telekommunikationsdienste</i>	<i>2,31 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Consumer Discretionary Distribution &amp; Retail</i>	<i>1,55 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Verbraucherservice</i>	<i>1,38 %</i>
<i>Öffentliche Dienstleistungen</i>	<i>Stromversorgungsunternehmen</i>	<i>1,38 %</i>

<i>Industrie</i>	<i>Verkehr</i>	<i>1,35 %</i>
<i>Öffentliche Dienstleistungen</i>	<i>Multi-Dienstprogramme</i>	<i>1,17 %</i>
<i>IT</i>	<i>Hardware und Ausrüstung</i>	<i>0,99 %</i>
<i>Kommunikationsdienste</i>	<i>Medien &amp; Unterhaltung</i>	<i>0,82 %</i>
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	<i>Consumer Staples Distribution &amp; Retail</i>	<i>0,79 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Metalle &amp; Bergbau</i>	<i>0,77 %</i>
<i>Immobilien</i>	<i>REITs</i>	<i>0,76 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Baumaterialien</i>	<i>0,70 %</i>
<i>Immobilien</i>	<i>Immobilienverwaltung und -entwicklung</i>	<i>0,49 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Papier- und Forstprodukte</i>	<i>0,44 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Behälter &amp; Verpackung</i>	<i>0,33 %</i>
<i>Öffentliche Dienstleistungen</i>	<i>Gasversorger</i>	<i>0,21 %</i>
<i>Öffentliche Dienstleistungen</i>	<i>Wasser Zubehör</i>	<i>0,18 %</i>
<i>Energie</i>	<i>Energieausrüstung und -dienstleistungen</i>	<i>0,13 %</i>
<i>Öffentliche Dienstleistungen</i>	<i>Unabhängige Erzeuger von Strom und erneuerbarer Energie</i>	<i>0,08 %</i>
<i>Sonstige</i>	<i>Sonstige</i>	<i>0,00 %</i>

Liquide Mittel	Liquide Mittel	0,50 %
----------------	----------------	--------



### 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 1,78 % 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.

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<sup>1</sup>) 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.

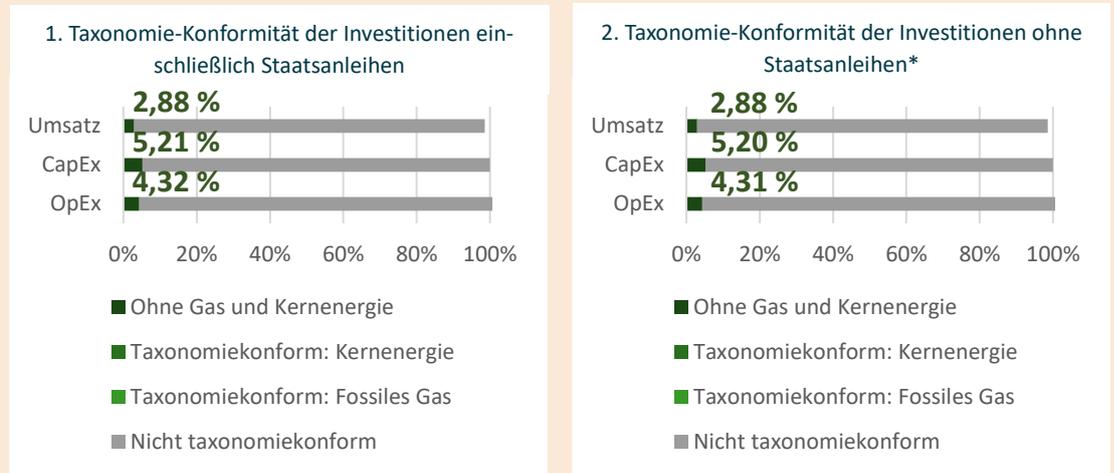
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die 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.

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



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

Die für diesen Bericht verwendeten Daten des Emittenten zur Anpassung an die EU-Taxonomie beziehen sich noch auf das Jahr 2022. Aktuellere Daten waren zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Jahresberichtes noch nicht verfügbar.

**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 CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

Zum 30.06.2024 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 0,07 % und der Anteil der Investitionen an ermöglichenden Tätigkeiten betrug 1,74 %.

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

Am Ende des vorherigen Zeitraums betrug der Prozentsatz der Investitionen mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden 0,46%.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der

 **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 **53,10 %**.

Der Anteil von **53,10 %** ist darauf zurückzuführen, dass einige Emittenten der im Teilsondervermögen gehaltenen Vermögensgegenstände zwar als nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung gelten (können), aber einen Teil ihrer Aktivitäten nicht mit den

EU-Taxonomiestandards in Einklang 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 **16,09 %**.



### 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. Für Anleihen und Aktien ohne Rating gelten Mindeststandards für Umwelt- und Sozialschutz durch Kontroversenprüfung anhand der Grundsätze des UN Global Compact.



### 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 STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index die Performance des STOXX® Europe 600 Index Unter Anwendung einer Reihe von Compliance-, Engagement- und ESG-Performance-Screenings, d.h. der Index enthält ca. 480 Indexkomponenten, wobei die "fehlenden" 120 Aktien aus dem Investmentuniversum des STOXX® Europe 600 Index aufgrund der ESG-Kriterien nicht ausgewählt wurden. Der STOXX® Europe 600 Index umfasst die 600 größten Aktien ausgewählter europäischer Länder. 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.

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren.

#### Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Der STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index verfolgt die Performance des STOXX® Europe 600 Index Unter Anwendung einer Reihe von Compliance-, Engagement- und ESG-Performance-Screenings, d.h. der Index enthält ca. 480 Indexkomponenten, wobei die "fehlenden" 120 Aktien aus dem Investmentuniversum des STOXX® Europe 600 Index aufgrund der ESG-Kriterien nicht ausgewählt wurden. Der STOXX® Europe 600 Index deckt die 600 größten Aktien ausgewählter europäischer Länder ab.

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
STOXX Europe 600 ESG+	76,22	99,79%
STOXX® Europe 600 Index	74,56	99,35%

#### 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 entsprachen insgesamt denjenigen des Indexes.

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>STOXX Europe 600 ESG+</b>	76,22	99,79%

● **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
	30/06/2024
<b>Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF</b>	14,15%
<b>STOXX Europe 600 ESG+</b>	14,02%
<b>Spread</b>	0,13%

● **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.

	1 Jahr
	30/06/2024
<b>Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF</b>	14,15%
<b>STOXX Europe 600</b>	10,71%
<b>Spread</b>	3,44%

## Angaben zur Vergütung gemäß § 101 (4) 1.-5. KAGB:

### VERGÜTUNGSRICHTLINIEN UND VERGÜTUNGSPRAXIS

Die Vergütungsrichtlinie von Amundi Luxembourg S.A. steht im Einklang mit den Anforderungen der am 18. März 2016 in Kraft getretenen Europäischen Verordnung 2014/91/EU, die im Luxemburger Gesetz vom 10. Mai 2016 umgesetzt wurden.

Die Vergütungsrichtlinie basiert auf der Rahmenordnung für Vergütungen der Unternehmensgruppe Amundi und wird jährlich vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg S.A. überprüft und genehmigt. Die Richtlinie unterliegt einer jährlichen unabhängigen Prüfung durch den internen Compliance-Bereich die, jeweils im vierten Quartal durchgeführt wird. In den wichtigsten Entwicklungen des Jahres 2023 wurde die Vergütungspolitik mit der "Amundi Ambition 2025" verknüpft und daher wurden ESG-Kriterien und Nachhaltigkeitsrisiken hinzugefügt. Es gab keine weiteren wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik der Vorjahre. Die für 2023 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 05. Oktober 2023 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2023 fand am 02. Februar 2023 statt. Die Ziele der Vergütungsrichtlinie und der Vergütungspraktiken stehen im Einklang mit einem fundierten und wirksamen Risikomanagement und unterstützen dies, indem sie die Vergütung an langfristigen Ergebnissen und Risiken ausrichten, um Interessenkonflikte zu vermeiden. Die Festvergütung steht in Zusammenhang mit den übernommenen Aufgaben, den erbrachten professionellen Dienstleistungen und dem Verantwortungsbereich und reflektiert den Grad der akademischen Ausbildung, das marktübliche Gehaltsniveau, die Erfahrung und die Kompetenzen, die für einzelne Positionen erforderlich sind, sowie das gezeigte Leistungs niveau. Die variable Vergütung soll eine nachhaltige langfristige Entwicklung der Verwaltungsgesellschaft und ein solides und wirksames System des Risikomanagements fördern. Bei der Zuerkennung einer variablen Vergütung wird die Leistung des Mitarbeiters, seines Geschäftsbereichs und der gesamten Amundi Group berücksichtigt und sie basiert sowohl auf finanziellen als auch auf nicht-finanziellen Kriterien. Amundi Luxembourg S.A. und die Unternehmensgruppe Amundi haben das gesamte identifizierte Personal definiert, das Befugnisse über die von Amundi verwalteten Fonds hat oder diese beeinflussen kann und das somit wahrscheinlich auf die Wertentwicklung oder das Risikoprofil unserer Fonds einwirken kann.

### HÖHE DER ZUERKANNTEN VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft Amundi Luxembourg S.A. ist zum 31.12.2023 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Geschäftsjahrs 2023 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	110	8,737,726.50	1,545,780.42	10,283,506.92
Davon				
Ermittelte Mitarbeiter	9	1,419,514.99	516,082.67	1,935,597.66
Alle sonstigen Mitarbeiter	101	7,318,211.51	1,029,697.75	8,347,909.26

Die oben genannten Zahlen der Gesamtvergütung beziehen sich auf Aktivitäten im Hinblick auf alle verwalteten Fonds. Mitarbeiter von Amundi Luxembourg S.A. und der Unternehmensgruppe Amundi, die in den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berufen werden, verzichten bezüglich aller verwalteten Fonds auf jegliche Vergütungsansprüche. Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft erhalten keine Beträge, die direkt vom OGAW oder AIF gezahlt werden, auch keine Gewinnbeteiligung und Performancegebühren.

### VERGÜTUNG DES AUSLAGERUNGSUNTERNEHMENS

Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi.

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 18,278 EUR, davon 8,833 EUR in der festen Vergütung und 9,445 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 103,681 EUR, davon 72,673 EUR in der festen Vergütung und 31,008 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2023 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1,923 Mitarbeiter von denen 100 Mitarbeiter identifiziert staff (\*) waren.

(\*) Geschäftsleitung der Gesellschaft, Mitarbeiter deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Verwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen haben, sowie bestimmte weitere Mitarbeiter („risikorelevante Mitarbeiter“ oder „Risktaker“)

Luxemburg, den 02. Oktober 2024

Amundi Luxembourg S.A

# Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF

## Vermögensübersicht zum 30.Juni 2024

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>277.760.256,16</b>	<b>100,04</b>
1. Aktien		276.911.381,30	99,73
- Banken	12.519.964,15		4,51
- Bau und Baustoffe	3.749.451,32		1,35
- Bergbau	1.228.012,07		0,44
- Chemische Industrie	24.073.710,56		8,67
- Einzelhandel	6.073.548,91		2,19
- Elektrik / Elektronik	14.394.190,01		5,18
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	46.353.165,65		16,69
- Pharmaindustrie / Biotech	22.272.862,80		8,02
- Real Estate	6.943.816,98		2,50
- Software	20.635.885,20		7,43
- Sonstige Finanzdienstleistungen	10.385.711,70		3,74
- Sonstige industrielle Werte	21.054.313,62		7,58
- Telekommunikation	21.723.986,92		7,82
- Textilien und Kleidung	11.901.180,13		4,29
- Transportation	10.767.391,33		3,88
- Versicherungen	42.834.189,95		15,43
2. Derivate		1.578,50	0,00
3. Bankguthaben		797.051,76	0,29
4. Sonstige Vermögensgegenstände		56.572,60	0,02
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-114.424,15</b>	<b>-0,04</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>277.652.160,01</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.



Umlaufende Anteile

STK

6.916.732

Fußnoten:

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Differenzen entstanden sein.

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

Die Vermögensgegenstände des Teilsondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2024

**Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.06.2024**

US-Dollar (USD) 1,07175 = 1 EUR

**Marktschlüssel**

**Terminbörsen**

EUREX European Exchange

Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen:  
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE000BAY0017	Bayer AG	STK	4.059	268.750	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	86.121	321.739	
<b>Ausland</b>					
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	0	61.439	
<b>Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
<b>Gekaufte Kontrakte</b> (Basiswert(e): DAX INDEX-Future)					
					9.375

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		9.210.939,43	1,332
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		394,57	0,000
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		15.030,56	0,002
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-1.233.705,64	-0,178
5. Sonstige Erträge		581,28	0,000
davon: Sonstiges	581,28		0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>7.993.240,20</b>	<b>1,156</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-0,50	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-386.864,53	-0,056
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-386.865,03</b>	<b>-0,056</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>7.606.375,17</b>	<b>1,100</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		11.578.569,21	1,674
2. Realisierte Verluste		-10.235.798,50	-1,480
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>1.342.770,71</b>	<b>0,194</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>8.949.145,88</b>	<b>1,294</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		18.186.274,40	2,629
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		6.187.096,55	0,895
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>24.373.370,95</b>	<b>3,524</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>33.322.516,83</b>	<b>4,818</b>

**Entwicklung des Teilsondervermögens**

	EUR	2023 / 2024 EUR
<b>I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		264.525.725,78
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-8.890.843,10
2. Mittelzufluss (netto)		-12.329.507,75
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	100.307.247,31	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-112.636.755,06	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		1.024.268,25
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		33.322.516,83
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	18.186.274,40	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	6.187.096,55	
<b>II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>277.652.160,01</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>41.023.753,25</b>	<b>5,931</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		32.074.607,37	4,637
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		8.949.145,88	1,294
3. Zuführung aus dem Sondervermögen <sup>2)</sup>		0,00	0,000
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>33.415.348,05</b>	<b>4,831</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		33.415.348,05	4,831
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>7.608.405,20</b>	<b>1,100</b>
1. Endausschüttung		7.608.405,20	1,100

1) Durch Rundung bei der Berechnung können sich geringfügige Differenzen ergeben.

2) Die Zuführung aus dem Sondervermögen dient dem Ausgleich von im Geschäftsjahr realisierten Verluste, die damit bei der Berechnung der Ausschüttung unberücksichtigt bleiben; im Ergebnis kann sich damit für das laufende oder für künftige Geschäftsjahre eine Substanzausschüttung im investimentrechtlichen Sinne ergeben.

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsondervermö am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2023/2024	277.652.160,01	40,14
2022/2023	264.525.725,78	37,09
2021/2022	191.978.900,37	31,37
2020/2021	194.073.479,88	39,29

# Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

**Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure** EUR **1.578,50**  
Das durch Derivate erzielte Exposure wurde gemäß § 16 Abs. 7 DerivateV ermittelt. Dabei wurden die Marktwerte der zugrundeliegenden Basiswerte DAX INDEX herangezogen.

**Vertragspartner der derivativen Geschäfte**  
BNP Paribas S.A.

Die Auslastung der Obergrenze für das Marktrisikopotential wurde für dieses Sondervermögen gemäß der Derivateverordnung nach dem einfachen Ansatz ermittelt.

### Sonstige Angaben

#### Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF

**International Security Identification Number (ISIN)**

<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>DE000ETF9090</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>40,14</b>
Anleger		<b>6.916.732</b>
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	Private Anleger
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Mindeststückelung	Anteil	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	1,00
Ertragsverwendung		0,15
		ausschüttend

**Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)**

**99,73**

**Bestand der Derivate am Fondsvermögen (in %)**

**0,00**

#### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an Börsen zugelassen sind noch in einem anderen organisierten Markt zugelassen oder in diesen einbezogen sind oder für die kein handelbarer Kurs verfügbar ist, werden zu dem aktuellen Verkehrswert bewertet, der bei sorgfältiger Einschätzung nach geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten angemessen ist.

Im Geschäftsjahr sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2024 wurden die folgenden Vermögensgegenstände nicht zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs bewertet:

Bankguthaben und sonst. Vermögensgegenstände	zum Nennwert
Verbindlichkeiten	zum Rückzahlungsbetrag
Fremdwährungsumrechnung	auf Basis der Closing Spot-Kurse von WM Company / Reuters

#### Angaben zur Transparenz sowie zur Gesamtkostenquote gem. § 16 (1) Nr.3 KARBV

##### Wesentliche sonstige Erträge und sonstige Aufwendungen (vor Ertragsausgleich):

Die im abgelaufenen Geschäftsjahr angefallenen sonstigen Erträge setzten sich zusammen aus:

Gutschrift bezahlten CSDR Gebühren EUR 620,21

##### Gesamtkostenquote (in %)

**0,15**

Die Gesamtkostenquote drückt sämtliche vom Teils Sondervermögen im Jahresverlauf getragenen Kosten und Zahlungen (ohne Transaktionskosten) im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettoinventarwert des Teils Sondervermögens aus.

##### Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teils Sondervermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwendererstattungen, mit denen das jeweilige Teils Sondervermögen belastet wird, kann dem jeweiligen Besonderen Teil des Verkaufsprospektes sowie den AAB und BAB entnommen werden. Die Pauschalgebühr wird nach dem durchschnittlichen täglichen Nettoinventarwert der Anteilklasse der jeweiligen Teils Sondervermögen berechnet und ist jeweils monatlich oder vierteljährlich nachträglich zu zahlen. Mit der Pauschalgebühr sind alle Leistungen der Gesellschaft und Dritter (z.B. Verwahrstelle, Abschlussprüfer, usw.) abgegolten, soweit nicht im Folgenden etwas Abweichendes geregelt ist.

##### An die Verwaltungsgesellschaft oder Dritte gezahlte Pauschalvergütungen inkl. Ertragsausgleich

**Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)** EUR **400.180,02**

Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft % 50,06

Davon für die Verwahrstelle % 34,71

Davon für Dritte % 15,23

##### Transaktionskosten

EUR

**22.073,29**

Summe der Nebenkosten des Erwerbs (Anschaffungsnebenkosten) und der Kosten der Veräußerung der Vermögensgegenstände.

Die im abgelaufenen Berichtsjahr angefallenen Transaktionskosten wurden von der EU-Verwaltungsgesellschaft, Amundi Luxembourg S.A., getragen. Aus diesem Grund sind keine Transaktionskosten in den einzelnen Teils Sondervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teils Sondervermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundene Unternehmen und Personen sind, betrug 0,00%. Ihr Umfang belief sich hierbei auf insgesamt 0,00 EUR.

##### Angaben zu den Kosten

Die EU-Verwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Teils Sondervermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandserstattungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

##### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert) 0,31%

Höhe der Annual Tracking Difference -0,69%

Der im Geschäftsjahr 2023/2024 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error.

##### Erläuterungen zur Ertrags- und Aufwandsrechnung

Die Ermittlung der Nettoveränderung der nichtrealisierten Gewinne und Verluste erfolgt dadurch, dass in jedem Geschäftsjahr die in den Anteilspreis einfließenden Wertansätze der Vermögensgegenstände mit den jeweiligen historischen Anschaffungskosten verglichen werden, die Höhe der positiven Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Gewinne einfließen, die Höhe der negativen Differenzen in die Summe der nichtrealisierten Verluste einfließen und aus dem Vergleich der Summenpositionen zum Ende des Geschäftsjahres mit den Summenpositionen zum Anfang des Geschäftsjahres die Nettoveränderungen ermittelt werden.

##### Angaben zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß Verordnung (EU) Nr. 2015/2365

Im Geschäftsjahr wurden keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Gesamtrendite-Swaps im Sinne im Sinne der Verordnung (EU) Nr. 2015/2365 abgeschlossen.

##### Information zur "Voting Rights Policy"

Die aktuelle „Voting Rights Policy“ der Amundi Luxembourg S.A. gilt nur für luxemburgische und französische Fonds. Derzeit findet kein Proxy Voting für deutsche Fonds statt. Dieser Service soll zukünftig auch für deutsche Sondervermögen implementiert werden.

##### Offenlegung gemäß Art. 7 Offenlegungsverordnung:

Während des Berichtszeitraums beachtete die Gesellschaft für den Teilfonds die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen („Principal Adverse Impacts“ = PAI) dergestalt, dass der Indikator Nummer 14 „Engagement in umstrittene Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)“ des Anhangs 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288 im Rahmen der Investitionsentscheidungen berücksichtigt wurde. Dies erfolgte über die normative Ausschlusspolitik der Amundi-Gruppe; konkret:

Vermögensgegenstände (i) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf oder der Lagerung von chemischen, biologischen und abgereicherten Uranwaffen beteiligt sind sowie (ii) von Emittenten, die an der Herstellung, dem Verkauf, der Lagerung oder der Erbringung von Dienstleistungen für bzw. von Antipersonenminen und Streubomben, die nach den Verträgen von Ottawa und Oslo verboten sind, beteiligt sind, waren zum Erwerb für den Teilfonds ausgeschlossen.

Die Darstellung der offenzulegenden Informationen für regelmäßige Berichte für Finanzprodukte im Sinne des Artikels 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 sowie im Sinne des Artikels 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 kann im hinteren Teil des Berichts entnommen werden.

**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 DAX 50 ESG II UCITS ETF **Unternehmenskennung (LEI-Code):** 529900GFNNJ8CI4K9B60

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?**

**Ja**

   **Nein**

- |   |   |
|---|---|
| <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____</p> <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> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____</p> | <p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit <b>ökologische/soziale Merkmale beworben</b> und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es <b>64,55 %</b> an nachhaltigen Investitionen</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</li> <li><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</li> </ul> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p> |
|---|---|



**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 DAX® 50 ESG (Performance Index) (der "Index"). Das Teilsondervermögen förderte ökologische und/oder soziale Merkmale, einschließlich durch die Integration von Umwelt-, Sozial- und Governance-Ratings ("ESG") durch den Datenanbieter Sustainalytics

Insbesondere verfolgt der DAX® 50 ESG-Index die Leistung der 50 größten, die meisten liquiden deutschen Marktanteile, die standardisierte ESG-Screenings im Zusammenhang mit dem Global Standards Screening durchlaufen haben, sowie die Beteiligung an umstrittenen Waffen, der Tabakproduktion, der thermischen Kohle, der Kernenergie und militärischen Verträgen, Sie zeichnen sich durch eine vergleichbar gute Leistung auf der Grundlage ihrer Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien aus, die auf der Grundlage von ESG-Kriterien als nachhaltig gelten.

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 DAX® 50 ESG-Index, dessen ESG-Rating des Datenanbieters Sustainalytics auch das ESG-Rating des Portfolios darstellt. Der ESG-Score des DAX® 50 ESG-Index des Datenanbieters Sustainalytics am Ende des Zeitraums betrug:

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>DAX 50 ESG</b>	<b>77,49</b>	<b>100%</b>

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

Am Ende des vorherigen Zeitraums der ESG-Score des DAX® 50 ESG-Index des Datenanbieters Sustainalytics betrug **77,23**.

● **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 dem oben genannten Ziel 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 seiner Ausschlusspolitik als Teil der Grundsätze für nachhaltiges Investieren von Amundi Group bereits bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen (Principle 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 sektorbezogen), der Integration von ESG-Ratings in den Anlageprozess, Engagement und Abstimmungsansätzen:

- **Ausschluss:** Amundi Group hat normative, tätigkeitsbasierte und sektorbasierte 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?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 01.07.2023 bis 30.06.2024**

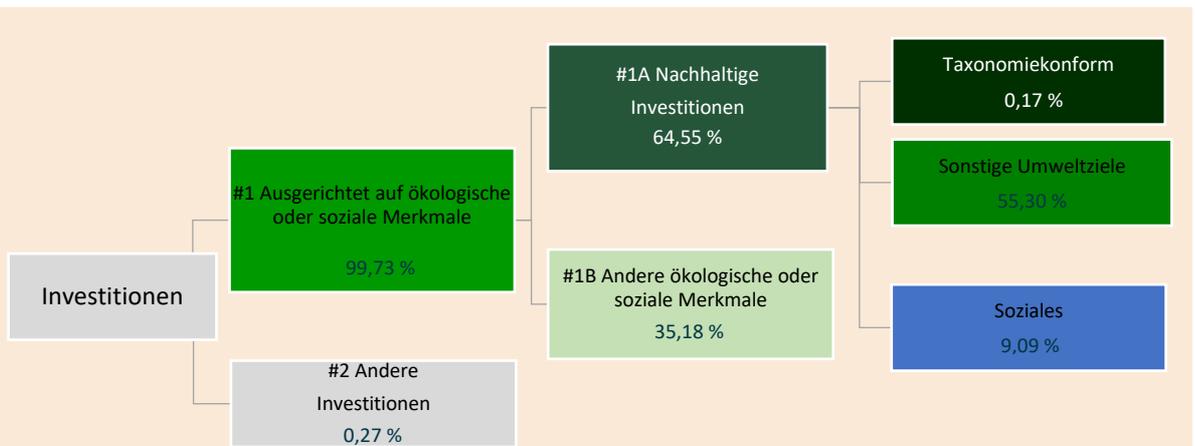
Größte Investitionen	Sektor	TeilSektor	Land	In % der Vermögenswerte
SAP SE / XETRA	IT	IT-Software und -Services	Deutschland	7,43 %
DEUTSCHE TELEKOM NAM (XETRA)	Kommunikationsdienste	Telekommunikationsdienste	Deutschland	7,27 %
SIEMENS AG-REG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	7,10 %
ALLIANZ SE-REG	Finanzwesen	Versicherungen	Deutschland	7,07 %
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	Finanzwesen	Versicherungen	Deutschland	6,44 %
MERCEDES-BENZ GROUP AG	Zyklische Konsumgüter	Automobile & Komponenten	Deutschland	4,92 %
INFINEON TECHNOLOGIES AG	IT	Halbleiter & Halbleiterausüstung	Deutschland	4,62 %
BASF SE XETRA	Grundstoffe	Chemikalien	Deutschland	4,15 %
DHL GROUP (XETRA)	Industrie	Verkehr	Deutschland	3,88 %
ADIDAS AG	Zyklische Konsumgüter	Langlebige Konsumgüter und Kleidung	Deutschland	3,82 %
DEUTSCHE BÖRSE AG	Finanzwesen	Finanzdienstleistungen	Deutschland	3,74 %
DEUTSCHE BANK NAMEN	Finanzwesen	Finanzdienstleistungen	Deutschland	3,06 %
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	Zyklische Konsumgüter	Automobile & Komponenten	Deutschland	2,72 %
VOLKSWAGEN AG-PFD	Zyklische Konsumgüter	Automobile & Komponenten	Deutschland	2,24 %
DAIMLER TRUCK	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	2,21 %

Die Daten in der obigen Tabelle basieren auf einem einzelnen Portfolio-Beobachtungspunkt zum Berichtszeitpunkt 28. Juni 2024.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?



**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die für diesen Bericht verwendeten Daten des Emittenten zur Anpassung an die EU-Taxonomie sind verspätet und beziehen sich noch auf das Jahr 2022. Aktuellere Daten waren zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Jahresberichtes noch nicht verfügbar.

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

<b>Sektor</b>	<b>Teilsektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
<i>Finanzwesen</i>	<i>Versicherungen</i>	15,43 %
<i>Industrie</i>	<i>Investitionsgüter</i>	13,20 %
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Automobile &amp; Komponenten</i>	11,92 %
<i>Grundstoffe</i>	<i>Chemikalien</i>	7,83 %
<i>IT</i>	<i>IT-Software und -Services</i>	7,43 %
<i>Kommunikationsdienste</i>	<i>Telekommunikationsdienste</i>	7,27 %
<i>Finanzwesen</i>	<i>Finanzdienstleistungen</i>	6,80 %
<i>IT</i>	<i>Halbleiter &amp; Halbleiterausüstung</i>	4,62 %
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Langlebige Konsumgüter und Kleidung</i>	4,54 %
<i>Industrie</i>	<i>Verkehr</i>	3,88 %
<i>Gesundheit</i>	<i>Gesundheits-Dienstleistungen und -Ausrüstung</i>	3,71 %
<i>Gesundheit</i>	<i>Pharma Biotech &amp; Life Sciences</i>	3,52 %
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	<i>Körperpflegeprodukte</i>	2,76 %
<i>Immobilien</i>	<i>Immobilienverwaltung und -entwicklung</i>	2,50 %
<i>Finanzwesen</i>	<i>Banken</i>	1,45 %

<i>Grundstoffe</i>	<i>Baumaterialien</i>	<i>1,35 %</i>
<i>Kommunikationsdienste</i>	<i>Medien &amp; Unterhaltung</i>	<i>0,55 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Consumer Discretionary Distribution &amp; Retail</i>	<i>0,54 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Metalle &amp; Bergbau</i>	<i>0,44 %</i>
<i>Sonstige</i>	<i>Sonstige</i>	<i>0,00 %</i>
<i>Liquide Mittel</i>	<i>Liquide Mittel</i>	<i>0,27 %</i>

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die 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.



**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 0,17 % in nachhaltige Investitionen investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen. Diese Investitionen trugen zu den Zielen der EU-Taxonomie im Hinblick auf die Klimaschutzmaßnahmen bei.

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:

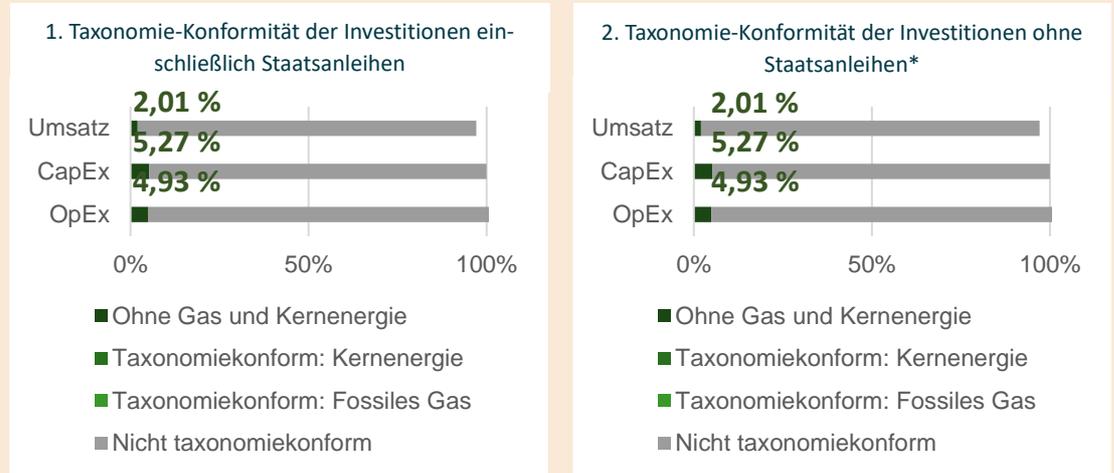
In fossiles Gas     In Kernenergie

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, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.**



\* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopapierarten.

Die für diesen Bericht verwendeten Daten des Emittenten zur Anpassung an die EU-Taxonomie beziehen sich noch auf das Jahr 2022. Aktuellere Daten waren zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Ja nicht verfügbar.

**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 CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

Zum 30.06.2024 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 0,02 % und der Anteil der Investitionen an ermöglichenden Tätigkeiten betrug 1,48 %.

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

Am Ende des vorherigen Zeitraums betrug der Prozentsatz der Investitionen mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden 1,10%.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem

 **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 **55,30 %**.

Umweltziel, **die die Kriterien** für öko- logisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**

Der Anteil von 55,30 % 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 **9,09 %**.



**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. Für Anleihen und Aktien ohne Rating gelten Mindeststandards für Umwelt- und Sozialschutz durch Kontroversenprüfung anhand der Grundsätze des UN Global Compact.



**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 die verbindliche Elemente in der Indexmethodik wird sichergestellt, dass die ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu jedem Zeitpunkt der Neugewichtung erfüllt werden. Insbesondere verfolgt der DAX® 50 ESG-Index zeichnet die Performance der 50 größten und liquidesten deutschen Marktbestände nach, die standardisierte ESG-Screenings im Zusammenhang mit Global Standards Screening sowie die Beteiligung an umstrittenen Waffen, Tabakproduktion, thermischer Kohle, Kernkraft und militärischem Contracting bestanden haben und weist eine vergleichsweise gute Performance auf, die auf ihren Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien beruht. 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?**

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren.

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

Der DAX® 50 ESG ist ein Aktienindex, der auf dem HDAX® basiert, der alle Unternehmen umfasst, die im DAX®, MDAX® und TecDAX® enthalten sind. Der DAX® 50 ESG wählt aus dem Anlageuniversum des HDAX® 50 Unternehmen, die auf Grundlage von ESG- Kriterien (Umwelt, Soziales und Unternehmensführung) besonders nachhaltig beurteilt werden aus und schließt Unternehmen aus, die eine negative Auswirkung auf bestimmte Nachhaltigkeitsfaktoren haben und bestimmte Ausschlusskriterien erfüllen.

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

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
DAX 50 ESG	77,49	100%
HDAX Index	76,62	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 entsprachen insgesamt denjenigen des Indexes.

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>DAX 50 ESG</b>	77,49	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
	30/06/2024
<b>Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF</b>	12,68%
<b>DAX 50 ESG</b>	13,36%
<b>Spread</b>	-0,69%

- **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
	30/06/2024
<b>Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF</b>	12,68%
<b>HDAX Index</b>	10,54%
<b>Spread</b>	2,14%

## Angaben zur Vergütung gemäß § 101 (4) 1.-5. KAGB:

### VERGÜTUNGSRICHTLINIEN UND VERGÜTUNGSPRAXIS

Die Vergütungsrichtlinie von Amundi Luxembourg S.A. steht im Einklang mit den Anforderungen der am 18. März 2016 in Kraft getretenen Europäischen Verordnung 2014/91/EU, die im Luxemburger Gesetz vom 10. Mai 2016 umgesetzt wurden.

Die Vergütungsrichtlinie basiert auf der Rahmenordnung für Vergütungen der Unternehmensgruppe Amundi und wird jährlich vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg S.A. überprüft und genehmigt. Die Richtlinie unterliegt einer jährlichen unabhängigen Prüfung durch den internen Compliance-Bereich die, jeweils im vierten Quartal durchgeführt wird. In den wichtigsten Entwicklungen des Jahres 2023 wurde die Vergütungspolitik mit der "Amundi Ambition 2025" verknüpft und daher wurden ESG-Kriterien und Nachhaltigkeitsrisiken hinzugefügt. Es gab keine weiteren wesentlichen Änderungen an der Vergütungspolitik der Vorjahre. Die für 2023 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 05. Oktober 2023 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2023 fand am 02. Februar 2023 statt. Die Ziele der Vergütungsrichtlinie und der Vergütungspraktiken stehen im Einklang mit einem fundierten und wirksamen Risikomanagement und unterstützen dies, indem sie die Vergütung an langfristigen Ergebnissen und Risiken ausrichten, um Interessenkonflikte zu vermeiden. Die Festvergütung steht in Zusammenhang mit den übernommenen Aufgaben, den erbrachten professionellen Dienstleistungen und dem Verantwortungsbereich und reflektiert den Grad der akademischen Ausbildung, das marktübliche Gehaltsniveau, die Erfahrung und die Kompetenzen, die für einzelne Positionen erforderlich sind, sowie das gezeigte Leistungsniveau. Die variable Vergütung soll eine nachhaltige langfristige Entwicklung der Verwaltungsgesellschaft und ein solides und wirksames System des Risikomanagements fördern. Bei der Zuerkennung einer variablen Vergütung wird die Leistung des Mitarbeiters, seines Geschäftsbereichs und der gesamten Amundi Group berücksichtigt und sie basiert sowohl auf finanziellen als auch auf nicht-finanziellen Kriterien. Amundi Luxembourg S.A. und die Unternehmensgruppe Amundi haben das gesamte identifizierte Personal definiert, das Befugnisse über die von Amundi verwalteten Fonds hat oder diese beeinflussen kann und das somit wahrscheinlich auf die Wertentwicklung oder das Risikoprofil unserer Fonds einwirken kann.

### HÖHE DER ZUERKANNTEN VERGÜTUNG

Die Verwaltungsgesellschaft Amundi Luxembourg S.A. ist zum 31.12.2023 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Geschäftsjahrs 2023 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	110	8,737,726.50	1,545,780.42	10,283,506.92
Davon				
Ermittelte Mitarbeiter	9	1,419,514.99	516,082.67	1,935,597.66
Alle sonstigen Mitarbeiter	101	7,318,211.51	1,029,697.75	8,347,909.26

Die oben genannten Zahlen der Gesamtvergütung beziehen sich auf Aktivitäten im Hinblick auf alle verwalteten Fonds. Mitarbeiter von Amundi Luxembourg S.A. und der Unternehmensgruppe Amundi, die in den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft berufen werden, verzichten bezüglich aller verwalteten Fonds auf jegliche Vergütungsansprüche. Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft erhalten keine Beträge, die direkt vom OGAW oder AIF gezahlt werden, auch keine Gewinnbeteiligung und Performancegebühren.

### VERGÜTUNG DES AUSLAGERUNGSUNTERNEHMENS

Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi.

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 18,278 EUR, davon 8,833 EUR in der festen Vergütung und 9,445 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 103,681 EUR, davon 72,673 EUR in der festen Vergütung und 31,008 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2023 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1,923 Mitarbeiter von denen 100 Mitarbeiter identifiziert staff (\*) waren.

(\*) Geschäftsleitung der Gesellschaft, Mitarbeiter deren Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Gesamtrisikoprofil der Verwaltungsgesellschaft und der von ihr verwalteten Sondervermögen haben, sowie bestimmte weitere Mitarbeiter („risikorelevante Mitarbeiter“ oder „Risktaker“)

Luxemburg, den 02.Oktober.2024

Amundi Luxembourg S.A

# Amundi

## Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

"Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die Amundi Luxembourg S.A.

### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresberichte der Teilsondervermögen Amundi MDAX ESG II UCITS ETF, Amundi DivDAX II UCITS ETF, Amundi TecDAX UCITS ETF, Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF und Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF der Umbrella-Konstruktion Amundi – bestehend aus dem zusammengefassten Tätigkeitsbericht für die Teilsondervermögen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2023 bis zum 30. Juni 2024, den Vermögensübersichten und den Vermögensaufstellungen zum 30. Juni 2024, den Ertrags- und Aufwandsrechnungen, den Verwendungsrechnungen, den Entwicklungsrechnungen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2023 bis zum 30. Juni 2024 sowie den vergleichenden Übersichten über die letzten drei Geschäftsjahre, den Aufstellungen der während des Berichtszeitraums abgeschlossenen Geschäfte, soweit diese nicht mehr Gegenstand der Vermögensaufstellung sind, und den Anhängen – geprüft.

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entsprechen die beigefügten Jahresberichte in allen wesentlichen Belangen den Vorschriften des deutschen Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) und den einschlägigen europäischen Verordnungen und ermöglichen es unter Beachtung dieser Vorschriften, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen der Teilsondervermögen zu verschaffen.

### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Prüfung der Jahresberichte in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführt. Unsere Verantwortung nach diesen Vorschriften und Grundsätzen ist im Abschnitt „Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresberichte“ unseres Vermerks weitergehend beschrieben. Wir sind von der Amundi Luxembourg S.A. unabhängig in Übereinstimmung mit den deutschen handelsrechtlichen und berufsrechtlichen Vorschriften und haben unsere sonstigen deutschen Berufspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu den Jahresberichten zu dienen.

### Sonstige Informationen

Die gesetzlichen Vertreter sind für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen:

- die Angaben für die Teilsondervermögen Amundi MDAX ESG II UCITS ETF, Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF und Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF gemäß Art. 11 der Verordnung (EU) 2019/2088 sowie gemäß Art. 5 bis 6 der Verordnung (EU) 2020/852.

Unser Prüfungsurteil zu den Jahresberichten erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und dementsprechend geben wir in diesem Vermerk weder ein Prüfungsurteil noch irgendeine andere Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung haben wir die Verantwortung, die oben genannten sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen

- wesentliche Unstimmigkeiten zum jeweiligen Jahresbericht oder zu unseren bei der Prüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder
- anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten zu dem Schluss gelangen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

### Verantwortung der gesetzlichen Vertreter für die Jahresberichte

Die gesetzlichen Vertreter der Amundi Luxembourg S.A. sind verantwortlich für die Aufstellung der Jahresberichte, die den deutschen Vorschriften des KAGB und den einschlägigen europäischen Verordnungen in allen wesentlichen Belangen entsprechen und dafür, dass die Jahresberichte es unter Beachtung dieser Vorschriften ermöglichen, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen der Teilsondervermögen zu verschaffen. Ferner sind die gesetzlichen Vertreter verantwortlich für die internen Kontrollen, die sie als notwendig bestimmt haben, um die Aufstellung der Jahresberichte zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen (d.h. Manipulationen der Rechnungslegung und Vermögensschädigungen) oder Irrtümern sind.

Bei der Aufstellung der Jahresberichte sind die gesetzlichen Vertreter dafür verantwortlich, Ereignisse, Entscheidungen und Faktoren, welche die weitere Entwicklung der Teilsondervermögen wesentlich beeinflussen können, in die Berichterstattung einzubeziehen. Das bedeutet u.a., dass die gesetzlichen Vertreter bei der Aufstellung der Jahresberichte die Fortführung der Teilsondervermögen durch die Amundi Luxembourg S.A. zu beurteilen haben und die Verantwortung haben, Sachverhalte im Zusammenhang mit der Fortführung der Teilsondervermögen - sofern einschlägig - anzugeben.

## **Verantwortung des Abschlussprüfers für die Prüfung der Jahresberichte**

Unsere Zielsetzung ist, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresberichte als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, sowie einen Vermerk zu erteilen, der unser Prüfungsurteil zu den Jahresberichten beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung durchgeführte Prüfung eine wesentliche falsche Darstellung stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich angesehen, wenn vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieser Jahresberichte getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Adressaten beeinflussen.

Während der Prüfung üben wir pflichtgemäßes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern in den Jahresberichten, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als das Risiko, dass aus Irrtümern resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen bzw. das Außerkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Prüfung der Jahresberichte relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit dieses Systems der Amundi Luxembourg S.A. abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der von den gesetzlichen Vertretern der Amundi Luxembourg S.A. bei der Aufstellung der Jahresberichte angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der von den gesetzlichen Vertretern dargestellten geschätzten Werte und damit zusammenhängenden Angaben.
- ziehen wir Schlussfolgerungen auf der Grundlage erlangter Prüfungsnachweise, ob eine wesentliche Unsicherheit im Zusammenhang mit Ereignissen oder Gegebenheiten besteht, die bedeutsame Zweifel an der Fortführung der Teilsondervermögen durch die Amundi Luxembourg S.A. aufwerfen können. Falls wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Vermerk auf die dazugehörigen Angaben in den Jahresberichten aufmerksam zu machen oder, falls diese Angaben unangemessen sind, unser Prüfungsurteil zu modifizieren. Wir ziehen unsere Schlussfolgerungen auf der Grundlage der bis zum Datum unseres Vermerks erlangten Prüfungsnachweise. Zukünftige Ereignisse oder Gegebenheiten können jedoch dazu führen, dass die Teilsondervermögen durch die Amundi Luxembourg S.A. nicht fortgeführt werden.
- beurteilen wir die Darstellung, den Aufbau und den Inhalt der Jahresberichte insgesamt, einschließlich der Angaben sowie ob die Jahresberichte die zugrunde liegenden Geschäftsvorfälle und Ereignisse so darstellen, dass die Jahresberichte es unter Beachtung der Vorschriften des deutschen KAGB und der einschlägigen europäischen Verordnungen ermöglichen, sich ein umfassendes Bild der tatsächlichen Verhältnisse und Entwicklungen der Teilsondervermögen zu verschaffen.

Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen."

**Eschborn/Frankfurt am Main, 2. Oktober 2024**

**EY GmbH & Co. KG**  
**Wirtschaftsprüfungsgesellschaft**

**Kruse**  
**Wirtschaftsprüfer**

**Lattwein**  
**Wirtschaftsprüfer**