

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
I. Vermögensgegenstände		62.422.529,45	100,06
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
II. Verbindlichkeiten		-38.572,66	-0,06
III. Teilsondervermögen		62.383.956,79	100,00 ¹⁾

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
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
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
Summe Wertpapiervermögen								EUR 62.189.177,94	99,69
Derivate								EUR 290,50	0,00
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
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
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:								EUR 216.431,11	0,35
Verwahrstelle			EUR	216.431,11			% 100,000	216.431,11	0,35
Sonstige Vermögensgegenstände								EUR 16.629,90	0,03
Initial Margin			EUR	14.746,40				14.746,40	0,02
Variation Margin			EUR	1.883,50				1.883,50	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten								EUR -38.572,66	-0,06
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-38.572,66				-38.572,66	-0,06
Wert des Teilsondersvermögens								EUR 62.383.956,79	100,00¹⁾
Anteilwert								EUR 188,67	
Umlaufende Anteile								STK 330.650	

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
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	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte (Basiswert(e): DAX INDEX-Future)					

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

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Erträge			
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
Summe der Erträge		2.649.434,87	8,013
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-0,06	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-150.362,12	-0,455
Summe der Aufwendungen		-150.362,18	-0,455
III. Ordentlicher Nettoertrag		2.499.072,69	7,558
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		3.677.334,85	11,122
2. Realisierte Verluste		-1.120.544,20	-3,389
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		2.556.790,65	7,733
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		5.055.863,34	15,291
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-129.769,94	-0,392
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-1.713.195,22	-5,181
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.842.965,16	-5,574
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		3.212.898,18	9,717

Entwicklung des Teils Sondervermögens

	2023 / 2024
	EUR
I. Wert des Teils Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	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
II. Wert des Teils Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	62.383.956,79

Verwendung der Erträge des Teils Sondervermögens

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

Geschäftsjahr	Teils Sondervermögen am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
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
I. Vermögensgegenstände		107.602.021,54	100,08
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
II. Verbindlichkeiten		-88.234,42	-0,08
III. Teilsondervermögen		107.513.787,12	100,00 ¹⁾

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 im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondervermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
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	
DE000A0Z2Z25	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	
DE000KSAG888	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	
							EUR	104.178.308,85	96,90	
Ausland										
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	
							EUR	106.631.347,92	99,18	
Summe Wertpapiervermögen								EUR	106.631.347,92	99,18
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
Aktienindex-Derivate								EUR	1.169,00	0,00
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
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	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds										
EUR-Guthaben bei:							EUR	902.157,53	0,84	
Verwahrstelle			EUR	902.175,64		% 100,000		902.175,64	0,84	
Sonstige Vermögensgegenstände										
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	
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme										
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen							EUR	-18,11	-0,00	
Verwahrstelle			USD	-19,40		% 100,000		-18,11	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten										
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-88.234,42				-88.234,42	-0,08	
Wert des Teilsondervermögens										
Anteilwert							EUR	107.513.787,12	100,00 ¹⁾	
Umlaufende Anteile							EUR	128,21		
							STK	838.572		

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
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	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte					
(Basiswert(e): DAX INDEX-Future)					20.246
Verkaufte Kontrakte					
(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 ¹⁾ EUR
I. Erträge			
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
Summe der Erträge		2.354.723,02	2,808
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-0,15	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-340.297,23	-0,406
Summe der Aufwendungen		-340.297,38	-0,406
III. Ordentlicher Nettoertrag		2.014.425,64	2,402
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		5.230.488,90	6,237
2. Realisierte Verluste		-8.229.712,55	-9,814
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		-2.999.223,65	-3,577
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-984.798,01	-1,174
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-4.689.831,24	-5,593
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-3.717.889,55	-4,434
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-8.407.720,79	-10,026
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		-9.392.518,80	-11,201

Entwicklung des Teilsondervermögens

	2023 / 2024
	EUR
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	129.151.549,56
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
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	107.513.787,12

Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens

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

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

Bestand der Wertpapiere am Fondsvermögen (in %)	99,18
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	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 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	373.422,82
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 Aufwendererstattungen.

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 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 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
MDAX ESG+	54,71	100%

● **... 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 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 CO₂-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 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**

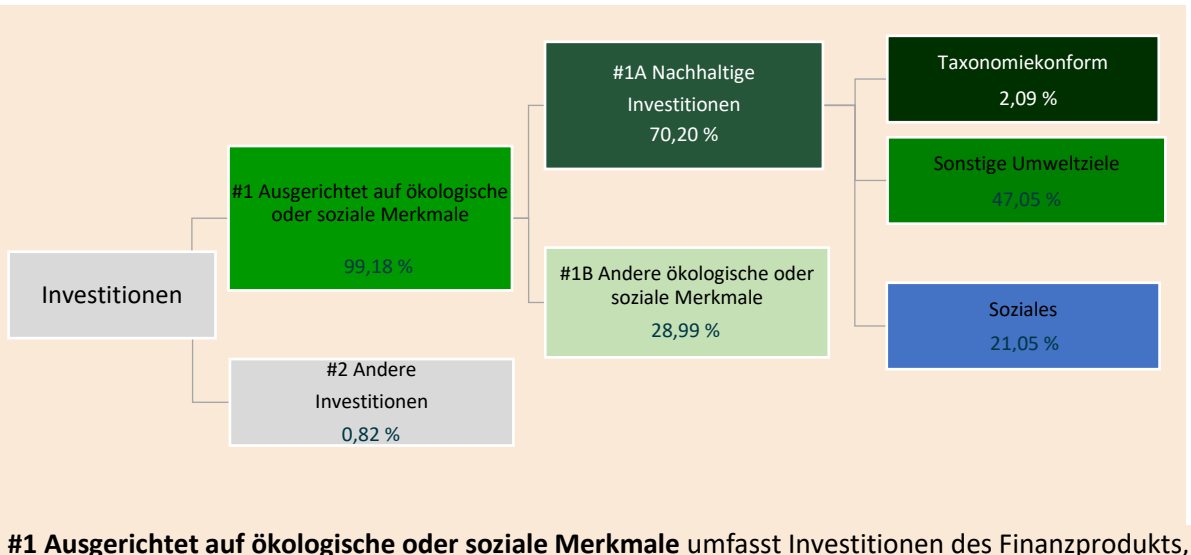
Größte Investitionen	Sektor	TeilSektor	Land	In % der Vermögenswerte
FRESEN MED CARE AG	Gesundheit	Gesundheits-Dienstleistungen und -Ausrüstung	Deutschland	6,48 %
GEA GROUP AG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	5,57 %
DEUTSCHE LUFT-HANSA	Industrie	Verkehr	Deutschland	5,29 %
LEG IMMOBILIEN AG	Immobilien	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?

<i>Sektor</i>	<i>Teilsektor</i>	<i>In % der Vermögenswerte</i>
<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 & 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 & Life Sciences</i>	<i>4,12 %</i>
<i>Finanzwesen</i>	<i>Versicherungen</i>	<i>4,08 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Metalle & 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 Kernenergie¹ investiert?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

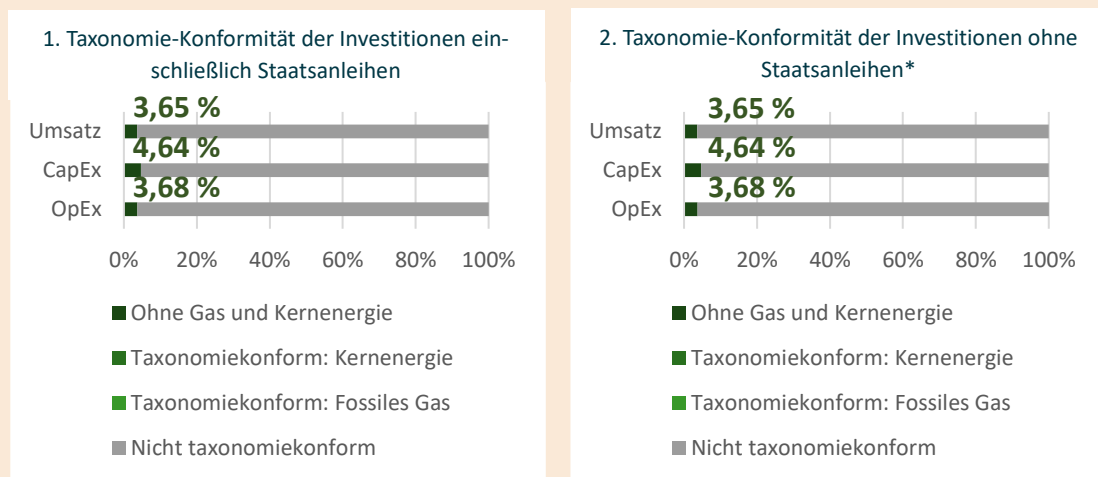
Nein

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

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels (Klimaschutz²) 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 CO₂-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 Bewertungs-Methodik 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
MDAX ESG+	54,71	100%
MDAX Index	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
MDAX ESG+	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
Amundi MDAX ESG II UCITS ETF	-8,82%
MDAX ESG+	-8,76%
Spread	-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
Amundi MDAX ESG II UCITS ETF	- 8,82%
MDAX Index	- 8,82%
Spread	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
I. Vermögensgegenstände		80.920.312,77	100,10
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
II. Verbindlichkeiten		-81.958,12	-0,10
III. Teilsondervermögen		80.838.354,65	100,00¹⁾

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 Teilsonderversmögens
Börsengehandelte Wertpapiere									
Aktien									
Inland									
DE0005545503	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
							EUR	74.224.023,90	91,82
Ausland									
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
							EUR	6.394.523,80	7,91
Summe Wertpapiervermögen							EUR	80.618.547,70	99,73
Derivate								-1.212,00	0,00
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
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
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds							EUR	276.948,73	0,34
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle		EUR		276.968,28		% 100,000		276.968,28	0,34
Sonstige Vermögensgegenstände							EUR	26.028,34	0,03
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
Verbindlichkeiten aus Kreditaufnahme							EUR	-19,55	0,00
Kredite in Nicht-EU/EWR-Währungen									
Verwahrstelle		USD		-20,94		% 100,000		-19,55	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten							EUR	-81.958,12	-0,10
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR		-81.958,12				-81.958,12	-0,10
Wert des Teilsonderversmögens							EUR	80.838.354,65	100,00¹⁾
Anteilwert							EUR	24,55	
Umlaufende Anteile							STK	3.293.456	

Fußnoten:

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

Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

Die Vermögensgegenstände des Teilsonderversmögens 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 (Marktzuidnung zum Berichtsstichtag):

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
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	
Ausland					
US00486H1059	ADTRAN Holdings Inc.	STK	8.074	75.023	
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	0	211.041	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte					
(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 ¹⁾ EUR
I. Erträge			
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
Summe der Erträge		1.143.259,88	0,347
II. Aufwendungen			
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
Summe der Aufwendungen		-332.973,39	-0,101
III. Ordentlicher Nettoertrag		810.286,49	0,246
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		7.073.766,80	2,148
2. Realisierte Verluste		-5.301.747,83	-1,610
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.772.018,97	0,538
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.582.305,46	0,784
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		-2.333.532,19	-0,709
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		2.511.824,70	0,763
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		178.292,51	0,054
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		2.760.597,97	0,838

Entwicklung des Teilsondervermögens

	2023 / 2024
	EUR
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres	92.777.144,88
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-1.538.231,52
2. Mittelzufluss (netto)	-13.269.814,22
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
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres	80.838.354,65

Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens

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

DE000ETF9082

Anteilwert	EUR	24,55
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
I. Vermögensgegenstände		60.021.667,01	100,05
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
II. Verbindlichkeiten		-27.552,30	-0,05
III. Teilsondervermögen		59.994.114,71	100 ¹⁾

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

Amundi STOXX Europe 600 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	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondersvermögens	
					im Berichtszeitraum					
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK		1.062	160	126	EUR	223,000	236.826,00	0,39
DE0008404005	Allianz SE	STK		2.462	135	196	EUR	259,500	638.889,00	1,06
DE0006766504	Aurubis AG	STK		188	0	0	EUR	73,250	13.771,00	0,02
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		1.829	0	169	EUR	88,380	161.647,02	0,27
DE0005158703	Bechtle AG	STK		502	502	0	EUR	43,940	22.057,88	0,04
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK		638	38	54	EUR	136,550	87.118,90	0,15
DE000A1DAH00	Brenntag SE	STK		876	0	0	EUR	62,960	55.152,96	0,09
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		195	0	0	EUR	65,650	12.801,75	0,02
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK		6.225	29	0	EUR	14,185	88.301,63	0,15
DE0005439004	Continental AG	STK		662	0	86	EUR	52,900	35.019,80	0,06
DE0006062144	Covestro AG	STK		1.185	0	131	EUR	54,800	64.938,00	0,11
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG	STK		3.551	505	378	EUR	37,170	131.990,67	0,22
DE0005140008	Deutsche Bank AG	STK		12.927	756	766	EUR	14,908	192.715,72	0,32
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		1.171	38	33	EUR	191,100	223.778,10	0,37
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG	STK		4.302	1.396	1.318	EUR	5,710	24.564,42	0,04
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		6.156	745	712	EUR	37,790	232.635,24	0,39
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		22.114	1.429	954	EUR	23,480	519.236,72	0,87
DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG	STK		731	0	0	EUR	69,520	50.819,12	0,08
DE000EVNK013	Evonik Industries AG	STK		1.882	661	0	EUR	19,050	35.852,10	0,06
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA	STK		1.357	292	256	EUR	35,760	48.526,32	0,08
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK		2.473	0	198	EUR	27,880	68.947,24	0,11
DE000A3E5D64	Fuchs Petrolub SE	STK		551	551	0	EUR	42,680	23.516,68	0,04
DE0006602006	GEA Group AG	STK		872	0	0	EUR	38,900	33.920,80	0,06
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG	STK		195	57	101	EUR	100,300	19.558,50	0,03
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK		391	33	33	EUR	236,700	92.549,70	0,15
DE0006047004	Heidelberg Materials AG	STK		894	136	145	EUR	96,820	86.557,08	0,14
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA	STK		999	102	80	EUR	83,220	83.136,78	0,14
DE0006070006	HOCHTIEF AG	STK		167	201	34	EUR	106,200	17.735,40	0,03
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG	STK		348	0	0	EUR	41,770	14.535,96	0,02
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		8.133	349	305	EUR	34,305	279.002,57	0,47
DE000KSAG888	K+S Aktiengesellschaft	STK		1.104	1.104	0	EUR	12,575	13.882,80	0,02
DE000KGX8881	KION GROUP AG	STK		437	0	0	EUR	39,090	17.082,33	0,03
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG	STK		463	76	0	EUR	71,300	33.011,90	0,06
DE0005470405	LANXESS AG	STK		497	0	0	EUR	22,980	11.421,06	0,02
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE	STK		420	0	0	EUR	76,260	32.029,20	0,05
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG	STK		4.967	272	296	EUR	64,570	320.719,19	0,53
DE0006599905	Merck KGaA	STK		793	39	48	EUR	154,750	122.716,75	0,20
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG	STK		337	0	0	EUR	238,800	80.475,60	0,13
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		846	46	63	EUR	467,000	395.082,00	0,66
DE0006969603	PUMA SE	STK		624	0	100	EUR	42,870	26.750,88	0,04
DE0007164600	SAP SE	STK		6.476	753	1.047	EUR	189,520	1.227.331,52	2,05
DE0007165631	Sartorius AG	STK		151	0	17	EUR	219,000	33.069,00	0,06
DE000A12DM80	Scout24 AG	STK		398	0	0	EUR	71,200	28.337,60	0,05
DE0007236101	Siemens AG	STK		4.774	347	258	EUR	173,720	829.339,28	1,38
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK		4.066	670	0	EUR	24,310	98.844,46	0,16
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	STK		1.800	185	149	EUR	53,800	96.840,00	0,16
DE000SYM9999	Symrise AG	STK		779	0	0	EUR	114,300	89.039,70	0,15
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK		1.496	1.498	2	EUR	13,670	20.450,32	0,03
DE000TLX1005	Talanx AG	STK		320	0	0	EUR	74,550	23.856,00	0,04
DE0007500001	thyssenkrupp AG	STK		2.918	0	0	EUR	4,038	11.782,88	0,02
DE0007664039	Volkswagen AG	STK		1.273	0	0	EUR	105,400	134.174,20	0,22
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK		4.289	220	0	EUR	26,550	113.872,95	0,19
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG	STK		102	0	0	EUR	101,800	10.383,60	0,02
DE000ZAL1111	Zalando SE	STK		1.387	0	0	EUR	21,890	30.361,43	0,05
								EUR	7.396.957,71	12,33
Ausland										
GB00B1YW4409	3i Group PLC	STK		6.134	234	0	GBP	30,660	221.818,06	0,37
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S	STK		30	0	0	DKK	12.105,000	48.696,27	0,08
IT0001233417	A2A S.p.A.	STK		9.525	0	0	EUR	1,860	17.711,74	0,03
SE0011337708	AAK AB	STK		1.083	0	0	SEK	310,600	29.636,99	0,05
NL0000852564	Aalberts N.V.	STK		504	0	0	EUR	37,920	19.111,68	0,03
CH0012221716	ABB Ltd.	STK		10.299	681	348	CHF	49,920	533.851,91	0,89
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V.	STK		3.256	1.409	781	EUR	15,350	49.979,60	0,08
GB00BF8Q6K64	Abrdn PLC	STK		12.483	0	0	GBP	1,482	21.819,67	0,04
ES0125220311	Acciona S.A.	STK		140	0	0	EUR	110,300	15.442,00	0,03
FR0000120404	ACCOR S.A.	STK		1.281	175	0	EUR	38,300	49.062,30	0,08
BE0003764785	Ackermans & van Haaren N.V.	STK		167	0	0	EUR	161,500	26.970,50	0,04
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK		1.370	65	0	EUR	40,280	55.183,60	0,09
SE0014781795	Addtech AB	STK		1.524	0	0	SEK	263,400	35.367,54	0,06
CH0012138605	Adecco Group AG	STK		1.028	153	290	CHF	29,820	31.831,12	0,05
BE0003851681	Aedifica S.A.	STK		378	244	168	EUR	56,650	21.413,70	0,04
BE6344703309	Aedifica S.A. - Anrechte	STK		302	0	0	EUR	0,000	0,00	0,00
BMG0112X1056	AEGON Ltd.	STK		8.475	29.070	20.595	EUR	5,768	48.883,80	0,08
ES0105046009	Aena SME S.A.	STK		431	0	0	EUR	188,000	81.028,00	0,14
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.	STK		170	0	0	EUR	113,600	19.312,00	0,03
BE0974264930	AGEAS SA/NV	STK		1.008	0	0	EUR	42,680	43.021,44	0,07
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.	STK		5.845	343	707	EUR	27,590	161.263,55	0,27
IE00BFL3536	AIB Group PLC	STK		10.375	3.640	0	EUR	4,936	51.211,00	0,09
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.CI.	STK		3.631	507	152	EUR	161,280	585.607,68	0,98
NO0010345853	Aker BP ASA	STK		1.874	0	0	NOK	272,200	44.700,77	0,07
NL0013267909	Akzo Nobel N.V.	STK		1.030	0	0	EUR	56,780	58.483,40	0,10
CH0432492467	Alcon AG	STK		3.133	137	194	CHF	80,220	260.972,18	0,43
SE0000695876	Alfa Laval AB	STK		1.823	0	0	SEK	464,100	74.542,23	0,12
DK0061802139	ALK-Abelló AS	STK		1.146	1.146	755	DKK	153,100	23.527,16	0,04
LU2237380790	Allegro.eu	STK		3.488	977	0	PLN	37,700	30.520,51	0,05
FR0010220475	Alstom S.A.	STK		2.202	386	0	EUR	15,700	34.571,40	0,06

FR0000071946	Alten S.A.	STK	178	0	0	EUR	102,500	18.245,00	0,03
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK	2.777	90	131	EUR	62,140	172.562,78	0,29
DK0060946788	Ambu A/S	STK	983	0	0	DKK	134,000	17.663,14	0,03
IT0004056880	Amplifon S.p.A.	STK	802	802	0	EUR	33,240	26.658,48	0,04
IT0005598021	Amplifon S.p.A. - Anrechte	STK	802	802	0	EUR	0,000	0,02	0,00
FR0004125920	Amundi S.A.	STK	323	0	0	EUR	60,250	19.460,75	0,03
AT0000730007	Andritz AG	STK	553	128	0	EUR	57,850	31.991,05	0,05
GB00B1XZS820	Anglo American PLC	STK	7.689	464	557	GBP	25,020	226.901,90	0,38
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	STK	6.154	916	363	EUR	54,120	333.054,48	0,56
GB0000456144	Antofagasta PLC	STK	2.361	0	0	GBP	21,100	58.756,97	0,10
NL0006237562	Arcadis N.V.	STK	451	0	0	EUR	59,150	26.676,65	0,04
FR0010313833	Arkema S.A.	STK	333	0	0	EUR	81,150	27.022,95	0,05
GB0000536739	Ashtead Group PLC	STK	2.783	2.783	0	GBP	52,820	173.377,44	0,29
NL0000334118	ASM International N.V.	STK	287	35	29	EUR	711,800	204.286,60	0,34
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	2.524	169	161	EUR	964,200	2.433.640,80	4,06
NL0011872643	ASR Nederland N.V.	STK	1.046	170	0	EUR	44,510	46.557,46	0,08
SE0007100581	Assa-Abloy AB	STK	6.277	619	603	SEK	299,600	165.690,68	0,28
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.A.	STK	7.139	544	320	EUR	23,290	166.267,31	0,28
GB0009895292	AstraZeneca PLC	STK	9.769	523	449	GBP	123,560	1.423.668,86	2,37
SE0017486889	Atlas Copco AB	STK	15.892	918	965	SEK	199,200	278.915,10	0,46
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC	STK	5.645	5.645	0	GBP	8,012	53.344,03	0,09
GB00BPQY8M80	Aviva PLC	STK	16.448	0	0	GBP	4,766	92.458,77	0,15
FR0000120628	AXA S.A.	STK	12.071	772	830	EUR	30,570	369.010,47	0,62
SE0006993770	Axfod AB	STK	633	0	0	SEK	278,400	15.526,63	0,03
BE0974400328	Azelis Group N.V.	STK	897	0	0	EUR	16,760	15.033,72	0,03
IT0003261697	Azimut Holding S.p.A.	STK	676	252	498	EUR	22,020	14.885,52	0,02
FO0000000179	Bakkafrost P/F	STK	370	0	0	NOK	542,000	17.573,50	0,03
CH0012410517	Bâloise Holding AG	STK	268	0	0	CHF	158,200	44.024,30	0,07
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK	36.394	808	2.133	EUR	9,352	340.356,69	0,57
IT0005218380	Banco BPM S.p.A.	STK	8.854	0	0	EUR	6,014	53.247,96	0,09
PTBPC0AM0015	Banco Com. Português SA (BCP)	STK	64.525	65.794	1.269	EUR	0,337	21.719,12	0,04
ES0113860A34	Banco de Sabadell S.A.	STK	34.215	0	0	EUR	1,801	61.604,11	0,10
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK	98.571	3.640	7.566	EUR	4,331	426.861,72	0,71
IE00BD1RP616	Bank of Ireland Group PLC	STK	6.254	0	0	EUR	9,768	61.089,07	0,10
ES0113679137	Bankinter S.A.	STK	3.908	0	0	EUR	7,626	29.802,41	0,05
GB0031348658	Barclays PLC	STK	93.156	10.167	7.309	GBP	2,089	229.525,13	0,38
GB0000811801	Barratt Developments PLC	STK	6.173	0	0	GBP	4,722	34.379,80	0,06
CH0009002962	Barry Callebaut AG	STK	21	0	0	CHF	1.464,000	31.923,58	0,05
AT0000BAWAG2	BAWAG Group AG	STK	482	622	140	EUR	59,100	28.486,20	0,05
NL0012866412	BE Semiconductor Inds N.V.	STK	522	50	62	EUR	156,150	81.510,30	0,14
GB00BYQ0JC66	Beazley PLC	STK	3.800	0	0	GBP	7,080	31.732,03	0,05
CH1101098163	BELIMO Holding AG	STK	65	0	0	CHF	450,600	30.412,75	0,05
GB0000904986	Bellway PLC	STK	622	0	193	GBP	25,360	18.604,61	0,03
GB00BLJNL82	Berkeley Group Holdings PLC	STK	668	0	0	GBP	45,880	36.147,71	0,06
GB0002869419	Big Yellow Group PLC	STK	1.316	0	0	GBP	11,740	18.222,37	0,03
FR0013280286	bioMerieux	STK	296	0	0	EUR	88,750	26.270,00	0,04
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK	6.728	524	1.122	EUR	59,530	400.517,84	0,67
SE0020050417	Boliden AB	STK	1.637	0	0	SEK	339,100	48.908,08	0,08
FR0000039299	Bolloré S.A.	STK	4.229	0	1.234	EUR	5,480	23.174,92	0,04
FR0000120503	Bouygues S.A.	STK	1.611	0	0	EUR	29,970	48.281,67	0,08
GB0007980591	BP PLC	STK	110.373	8.405	7.835	GBP	4,752	618.614,73	1,03
IT0000066123	BPER Banca S.p.A.	STK	6.101	6.101	6.268	EUR	4,721	28.802,82	0,05
GB0001367019	British Land Co. PLC, The	STK	6.072	0	0	GBP	4,116	29.477,33	0,05
GB00B0N8QD54	Britvic PLC	STK	1.866	0	0	GBP	11,810	25.992,17	0,04
GB0030913577	BT Group PLC	STK	38.858	0	4.785	GBP	1,404	64.324,11	0,11
CH0002432174	Bucher Industries AG	STK	41	41	0	CHF	362,000	15.411,45	0,03
GB00B0744B38	Bunzl PLC	STK	2.117	0	0	GBP	30,100	75.156,81	0,13
GB0031743007	Burberry Group PLC	STK	2.298	0	0	GBP	8,778	23.791,76	0,04
FR0006174348	Bureau Veritas SA	STK	2.324	621	0	EUR	25,860	60.098,64	0,10
IT0001347308	BUZZI UNICEM S.p.A.	STK	554	746	192	EUR	37,580	20.819,32	0,03
ES0140609019	Caixabank S.A.	STK	22.569	0	1.614	EUR	4,943	111.558,57	0,19
FR0000125338	Capgemini SE	STK	1.070	35	52	EUR	185,700	198.699,00	0,33
FI0009013429	Cargotec Corp.	STK	245	245	0	EUR	74,950	18.362,75	0,03
FR0000120172	Carrefour S.A.	STK	3.388	0	0	EUR	13,200	44.721,60	0,07
SE0000379190	Castellum AB	STK	2.612	0	547	SEK	129,400	29.779,10	0,05
ES0105066007	Cellnex Telecom S.A.	STK	2.886	0	215	EUR	30,370	87.647,82	0,15
CH0225173167	Cembra Money Bank AG	STK	243	0	0	CHF	76,700	19.353,20	0,03
GB00B033F229	Centrica PLC	STK	34.334	0	0	GBP	1,349	54.628,26	0,09
CH0010570767	Chocoladef. Lindt & Sprüngli	STK	6	0	0	CHF	10.490,000	65.354,86	0,11
FR001400AJ45	Cie Génle Étis Michelin SCpA	STK	4.614	354	196	EUR	36,110	166.611,54	0,28
CH0012142631	Clariant AG	STK	1.431	0	0	CHF	14,140	21.010,68	0,04
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG	STK	1.483	438	202	GBP	26,980	47.191,53	0,08
BE0003593044	Cofinimmo S.A.	STK	168	12	9	EUR	56,350	9.466,80	0,02
DK0060448595	Coloplast AS	STK	1.027	280	0	DKK	836,600	115.212,06	0,19
CH0360826991	Comet Holding AG	STK	49	49	0	CHF	362,000	18.418,57	0,03
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.	STK	3.155	89	170	EUR	72,620	229.116,10	0,38
GB00BD6K4575	Compass Group PLC	STK	11.251	1.044	961	GBP	21,600	286.632,78	0,48
GB00BV9FP302	Computacenter PLC	STK	379	0	0	GBP	28,720	12.838,21	0,02
GB00BD3VFW73	ConvaTec Group PLC	STK	9.492	0	0	GBP	2,348	26.286,75	0,04
FR0000064578	Covivio S.A.	STK	312	167	164	EUR	44,380	13.846,56	0,02
GB0002318888	Cranswick PLC	STK	332	332	0	GBP	44,450	17.405,67	0,03
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.	STK	7.552	837	981	EUR	12,740	96.212,48	0,16
GB00BJFVLV09	Croda International PLC	STK	894	0	0	GBP	39,480	41.628,97	0,07
FR0000120644	Danone S.A.	STK	4.054	227	184	EUR	57,080	231.402,32	0,39
DK0010274414	Danske Bank AS	STK	4.255	0	0	DKK	207,500	118.393,35	0,20
FR0014003TT8	Dassault Systemes SE	STK	4.450	126	182	EUR	35,300	157.085,00	0,26
NL0015435975	Davide Campari-Milano N.V.	STK	3.676	705	0	EUR	8,824	32.437,02	0,05
IE0002424939	DCC PLC	STK	719	274	228	GBP	55,400	46.980,72	0,08
DK0060738599	Demant AS	STK	587	0	0	DKK	301,400	23.724,17	0,04
GB0002652740	Derwent London PLC	STK	690	0	0	GBP	22,600	18.392,40	0,03
GB0002374006	Diageo PLC	STK	13.914	650	802	GBP	24,895	408.549,90	0,68
BE0974259880	D'leteren Group S.A.	STK	131	64	100	EUR	198,100	25.951,10	0,04
GB0001826634	Diploma PLC	STK	822	822	0	GBP	41,480	40.215,32	0,07
CH0126673539	DKSH Holding AG	STK	210	0	0	CHF	60,700	13.236,07	0,02
NO0010161896	DNB Bank ASA	STK	5.484	312	560	NOK	209,700	100.775,08	0,17
GB0008220112	DS Smith PLC	STK	8.481	0	0	GBP	4,210	42.112,41	0,07
DK0060079531	DSV Panalpina A/S	STK	1.141	197	183	DKK	1.067,000	163.252,45	0,27
GB00B7KR2P84	EasyJet PLC	STK	2.326	2.326	0	GBP	4,577	12.556,58	0,02

PTEDP0AM0009	EDP - Energias de Portugal SA	STK	17.921	17.921	0	EUR	3,499	62.705,58	0,10
ES0127797019	EDP Renováveis S.A.	STK	2.142	421	0	EUR	13,050	27.953,10	0,05
SE0016589188	Electrolux, AB	STK	1.831	0	0	SEK	87,860	14.173,71	0,02
SE0000163628	Elekta AB	STK	2.067	797	1.619	SEK	66,200	12.055,98	0,02
BE0003822393	Elia Group	STK	250	107	109	EUR	87,450	21.862,50	0,04
FR0012435121	Elis S.A.	STK	1.170	0	0	EUR	20,220	23.657,40	0,04
FI0009007884	Elisa Oyj	STK	1.081	88	0	EUR	42,840	46.310,04	0,08
ES0130960018	Enagas S.A.	STK	1.434	0	0	EUR	13,890	19.918,26	0,03
FR0010208488	Engie S.A.	STK	11.464	371	406	EUR	13,335	152.872,44	0,25
IT0003132476	ENI S.p.A.	STK	14.810	2.345	1.810	EUR	14,354	212.582,74	0,35
IM00B5VQMV65	Entain PLC	STK	4.671	1.336	536	GBP	6,300	34.708,14	0,06
SE0015658109	Epiroc AB	STK	3.934	0	0	SEK	211,500	73.307,58	0,12
SE0012853455	EQT AB	STK	5.285	950	666	SEK	313,200	145.838,06	0,24
NO0010096985	Equinor ASA	STK	6.109	202	648	NOK	303,950	162.715,73	0,27
AT0000652011	Erste Group Bank AG	STK	2.125	192	207	EUR	44,240	94.010,00	0,16
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK	1.865	71	81	EUR	201,200	375.238,00	0,63
SE0009922164	Essity AB	STK	3.611	0	0	SEK	271,400	86.345,85	0,14
FR0000121121	Eurazeo SE	STK	257	0	0	EUR	74,350	19.107,95	0,03
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E.	STK	772	0	0	EUR	46,550	35.936,60	0,06
NL0006294274	Euronext N.V.	STK	588	246	251	EUR	86,500	50.862,00	0,08
GB00B19NLV48	Experian PLC	STK	5.786	458	421	GBP	36,860	251.544,45	0,42
SE0017832488	Fastighets AB Balder	STK	4.039	3.662	2.474	SEK	72,620	25.842,48	0,04
NL0011585146	Ferrari N.V.	STK	750	65	54	EUR	380,700	285.525,00	0,48
NL0015001FS8	Ferrovial SE	STK	3.152	3.262	3.359	EUR	36,260	114.291,52	0,19
IT0000072170	Finecobank Banca Fineco S.p.A.	STK	3.811	0	0	EUR	13,920	53.049,12	0,09
DK0010234467	FLSmith & Co. AS	STK	444	444	0	DKK	346,200	20.611,98	0,03
FR0000121147	Forvia SE	STK	1.030	0	0	EUR	11,055	11.386,65	0,02
CY0200352116	Frontline PLC	STK	857	0	0	NOK	279,700	21.005,38	0,04
NL00150003E1	Fugro N.V.	STK	926	926	0	EUR	22,560	20.890,56	0,03
CH0360674466	Galenica AG	STK	307	307	0	CHF	73,550	23.446,19	0,04
PTGAL0AM0009	Galp Energia SGPS S.A.	STK	2.928	0	406	EUR	19,720	57.740,16	0,10
CH0030170408	Geberit AG	STK	205	0	25	CHF	530,800	112.988,94	0,19
FR0010040865	Gecina S.A.	STK	288	0	0	EUR	85,950	24.753,60	0,04
CH1169151003	Georg Fischer AG	STK	480	0	0	CHF	60,250	30.029,59	0,05
SE0000202624	Getinge AB	STK	1.310	0	0	SEK	180,050	20.781,10	0,03
FR0010533075	Getlink SE	STK	2.027	0	0	EUR	15,450	31.317,15	0,05
CH0010645932	Givaudan SA	STK	50	6	4	CHF	4.260,000	221.172,32	0,37
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA	STK	1.210	0	0	NOK	190,800	20.231,17	0,03
IE0000669501	Glanbia PLC	STK	1.150	0	0	EUR	18,200	20.930,00	0,03
DK0010272632	GN Store Nord AS	STK	668	0	0	DKK	194,100	17.386,48	0,03
IE00B00MZ448	Grafton Group PLC	STK	1.189	580	861	GBP	9,283	13.018,21	0,02
GB00B63QSB39	Greggs PLC	STK	619	0	0	GBP	27,720	20.237,87	0,03
ES0171996087	Grifols S.A.	STK	1.785	0	0	EUR	7,860	14.030,10	0,02
BE0003797140	Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL)	STK	555	0	0	EUR	66,650	36.990,75	0,06
GB00BN7SWP63	GSK PLC	STK	27.185	3.040	1.471	GBP	15,295	490.410,54	0,82
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB	STK	3.788	0	609	SEK	167,650	55.952,26	0,09
GB00BMX86B70	Haleon PLC	STK	47.039	47.039	0	GBP	3,226	178.979,55	0,30
GB0004052071	Halma PLC	STK	2.274	0	0	GBP	27,060	72.577,04	0,12
GB00B1VZ0M25	Hargreaves Lansdown PLC	STK	2.227	2.227	0	GBP	11,320	29.733,61	0,05
GB0004161021	Hays PLC	STK	10.085	10.085	10.025	GBP	0,945	11.240,59	0,02
NL0000008977	Heineken Holding N.V.	STK	693	0	76	EUR	73,650	51.039,45	0,09
NL0000009165	Heineken N.V.	STK	1.825	191	0	EUR	90,300	164.797,50	0,27
CH0466642201	Helvetia Holding AG	STK	209	0	0	CHF	121,500	26.367,79	0,04
IT0001250932	Hera S.p.A.	STK	4.900	0	0	EUR	3,194	15.650,60	0,03
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK	221	11	10	EUR	2.140,000	472.940,00	0,79
SE0015961909	Hexagon AB	STK	13.095	665	0	SEK	119,650	138.045,53	0,23
SE0007074281	Hexpol AB	STK	1.596	1.596	0	SEK	118,000	16.592,78	0,03
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC	STK	978	0	0	GBP	18,910	21.812,80	0,04
BMG4593F1389	Hiscox Ltd.	STK	2.539	5.170	2.631	GBP	11,500	34.438,29	0,06
CH0012214059	Holcim Ltd.	STK	3.486	315	232	CHF	79,620	288.204,48	0,48
SE0011090018	Holmen AB	STK	523	0	0	SEK	417,200	19.224,28	0,03
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC	STK	3.397	3.397	0	GBP	8,785	35.198,03	0,06
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK	118.784	5.136	13.163	GBP	6,839	958.145,64	1,60
FI0009000459	Huhtamäki Oyj	STK	634	166	0	EUR	37,460	23.749,64	0,04
SE0001662230	Husqvarna AB	STK	2.442	0	0	SEK	84,940	18.275,20	0,03
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	36.532	1.950	2.281	EUR	12,115	442.585,18	0,74
NL0010801007	IMCD N.V.	STK	324	0	0	EUR	129,300	41.893,20	0,07
GB00GLP8L22	IMI PLC	STK	1.629	0	0	GBP	17,640	33.892,27	0,06
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK	6.922	292	322	EUR	46,360	320.903,92	0,53
SE0001515552	Indutrade AB	STK	1.625	0	0	SEK	271,600	38.885,46	0,06
GB00BMJ6DW54	Infoma PLC	STK	8.351	0	0	GBP	8,558	84.293,05	0,14
IT0005090300	Infrastrutt. Wireless Italiane	STK	2.139	0	0	EUR	9,750	20.855,25	0,03
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK	20.929	2.040	3.698	EUR	15,962	334.068,70	0,56
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group	STK	1.090	0	0	GBP	83,260	107.039,45	0,18
GB00BYT1DJ19	Intermediate Capital Grp PLC	STK	2.019	0	0	GBP	21,820	51.960,35	0,09
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA	STK	15.165	6.857	6.609	GBP	1,623	29.020,71	0,05
IT0001078911	Interpump Group S.p.A.	STK	502	0	0	EUR	41,480	20.822,96	0,03
GB0031638363	Intertek Group PLC	STK	1.027	0	0	GBP	47,940	58.069,68	0,10
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK	103.384	6.590	5.763	EUR	3,471	358.845,86	0,60
GB00BDVZY777	Intl. Distributions Svcs. PLC	STK	4.330	0	1.841	GBP	3,204	16.362,94	0,03
GB00B17BBQ50	Investec PLC	STK	4.160	0	0	GBP	5,735	28.138,94	0,05
FR0010259150	Ipsen S.A.	STK	217	0	0	EUR	114,500	24.846,50	0,04
FR0000073298	IPSOS S.A.	STK	234	234	0	EUR	58,900	13.782,60	0,02
DK0060542181	ISS AS	STK	940	345	226	DKK	119,400	15.050,18	0,03
IT0005211237	Italgas S.P.A.	STK	2.781	0	0	EUR	4,602	12.798,16	0,02
GB0033986497	ITV PLC	STK	24.021	0	0	GBP	0,805	22.806,99	0,04
NL0015000LU4	Iveco Group N.V.	STK	1.470	1.470	0	EUR	10,470	15.390,90	0,03
GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC	STK	16.320	0	0	GBP	1,195	23.002,18	0,04
NL0014332678	JDE Peet's N.V.	STK	691	380	371	EUR	18,600	12.852,60	0,02
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.	STK	1.965	319	248	EUR	18,250	35.861,25	0,06
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC	STK	1.308	0	0	GBP	15,670	24.174,51	0,04
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG	STK	1.409	1.409	1.425	CHF	50,200	73.445,62	0,12
DK0010307958	Jyske Bank A/S	STK	265	0	0	DKK	554,000	19.686,35	0,03
BE0003565737	KBC Groep N.V.	STK	1.615	152	108	EUR	65,900	106.428,50	0,18
FI0009004824	Kemira Oyj	STK	1.013	1.013	0	EUR	22,760	23.055,88	0,04
FR0000121485	Kering S.A.	STK	449	20	21	EUR	338,500	151.986,50	0,25
IE0004906560	Kerry Group PLC	STK	994	0	0	EUR	75,650	75.196,10	0,13
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	1.596	0	0	EUR	16,390	26.158,44	0,04

GB0033195214	Kingfisher PLC	STK	11.549	0	0	GBP	2,488	33.890,32	0,06
IE0004927939	Kingspan Group PLC	STK	934	0	0	EUR	79,500	74.253,00	0,12
FR0000121964	Klépierre S.A.	STK	1.191	229	0	EUR	24,980	29.751,18	0,05
NL0000009082	Kon. KPN N.V.	STK	26.332	7.337	2.298	EUR	3,580	94.268,56	0,16
FI0009013403	KONE Oyj	STK	2.402	132	277	EUR	46,090	110.708,18	0,18
FI0009005870	Konecranes Oyj	STK	432	576	144	EUR	52,950	22.874,40	0,04
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK	4.913	719	1.672	EUR	23,590	115.897,67	0,19
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG	STK	341	0	0	CHF	258,400	91.495,15	0,15
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX	STK	693	0	0	EUR	31,800	22.037,40	0,04
GB00BYW0PQ60	Land Securities Group PLC	STK	4.736	0	0	GBP	6,195	34.604,61	0,06
GB0005603997	Legal & General Group PLC	STK	36.689	0	0	GBP	2,270	98.229,68	0,16
FR0010307819	Legrand S.A.	STK	1.703	122	88	EUR	92,640	157.765,92	0,26
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK	391.816	23.174	34.029	GBP	0,547	252.969,37	0,42
CH0025751329	Logitech International S.A.	STK	966	0	87	CHF	86,920	87.186,25	0,15
GB00B0SWJX34	London Stock Exchange Group PLC	STK	3.226	698	95	GBP	94,000	357.662,32	0,60
GB00B4WFW713	Londonmetric Property PLC	STK	12.498	4.768	0	GBP	1,934	28.508,73	0,05
CH0013841017	Lonza Group AG	STK	475	59	49	CHF	490,400	241.877,37	0,40
FR0000120321	L'Oréal S.A.	STK	1.521	101	98	EUR	410,050	623.686,05	1,04
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK	1.614	92	102	EUR	713,600	1.151.750,40	1,92
JE00BJ1DLW90	Man Group Ltd.	STK	9.509	4.308	3.548	GBP	2,422	27.163,77	0,05
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA	STK	3.161	0	0	EUR	13,690	43.274,09	0,07
ES0105025003	Merlin Properties SOCIMI S.A.	STK	2.041	0	0	EUR	10,400	21.226,40	0,04
FI0009014575	Metso Outotec Oyj	STK	3.637	0	0	EUR	9,884	35.948,11	0,06
SE0001174970	Millicom Intl Cellular S.A.	STK	830	0	0	SEK	258,000	18.866,96	0,03
IT0004965148	Moncler S.p.A.	STK	1.339	0	0	EUR	57,060	76.403,34	0,13
GB00BMWC6P49	Mondi PLC	STK	2.431	2.431	0	GBP	15,185	43.539,23	0,07
NO0003054108	Mowi ASA	STK	2.674	0	0	NOK	177,700	41.639,56	0,07
SE0000375115	Mycronic AB	STK	624	624	0	SEK	408,600	22.464,00	0,04
GB00BDR05C01	National Grid PLC	STK	31.839	9.838	1.006	GBP	8,826	331.439,54	0,55
ES0116870314	Naturgy Energy Group S.A.	STK	966	0	0	EUR	20,160	19.474,56	0,03
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC	STK	40.975	8.733	0	GBP	3,118	150.687,09	0,25
FR0011675362	NEOEN S.A.	STK	476	476	0	EUR	37,660	17.926,16	0,03
FI0009013296	Neste Oyj	STK	2.776	216	186	EUR	16,625	46.151,00	0,08
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	16.571	1.092	1.182	CHF	91,720	1.578.206,86	2,63
FR0000044448	Nexans S.A.	STK	185	0	0	EUR	102,900	19.036,50	0,03
IT0005366767	Nexi S.p.A.	STK	3.791	0	0	EUR	5,694	21.585,95	0,04
GB0032089863	NEXT PLC	STK	759	759	0	GBP	90,360	80.890,77	0,13
SE0015988019	NIBE Industrier AB	STK	9.209	0	0	SEK	44,940	36.462,77	0,06
DK0010287663	NKT A/S	STK	328	114	219	DKK	609,500	26.807,55	0,04
GB00B7FC0762	NMC HEALTH PLC	STK	261	0	0	GBP	0,000	0,00	0,00
NL0010773842	NN Group N.V.	STK	1.815	266	0	EUR	43,450	78.861,75	0,13
FI0009000681	Nokia Oyj	STK	34.647	3.997	2.397	EUR	3,559	123.291,35	0,21
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK	21.795	1.533	1.940	EUR	11,115	242.251,43	0,40
NO0005052605	Norsk Hydro ASA	STK	9.403	1.266	0	NOK	66,500	54.795,56	0,09
CH0012005267	Novartis AG	STK	12.829	665	841	CHF	96,170	1.281.101,64	2,14
DK0062498333	Novo-Nordisk AS	STK	20.250	21.532	1.282	DKK	1.005,600	2.730.611,67	4,55
DK0060336014	Novozymes A/S	STK	2.275	953	0	DKK	426,100	129.987,80	0,22
NL0010558797	OCI N.V.	STK	793	0	223	EUR	22,790	18.072,47	0,03
AT0000743059	OMV AG	STK	762	4	245	EUR	40,660	30.982,92	0,05
FR0000133308	Orange S.A.	STK	12.915	689	594	EUR	9,354	120.806,91	0,20
FI0009014377	Orion Corp.	STK	792	275	287	EUR	39,860	31.569,12	0,05
NO0003733800	Orkla ASA	STK	4.289	0	844	NOK	86,750	32.604,89	0,05
DK0060252690	Pandora A/S	STK	509	129	204	DKK	1.051,000	71.734,84	0,12
CH0024608827	Partners Group Holding AG	STK	139	151	153	CHF	1.154,000	166.560,41	0,28
GB0006776081	Pearson PLC	STK	4.251	0	0	GBP	9,908	49.677,31	0,08
GB00BNNTLN49	Pennon Group PLC	STK	1.687	0	0	GBP	5,735	11.411,16	0,02
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	1.235	41	73	EUR	126,700	156.474,50	0,26
GB00BGXQNP29	Phoenix Group Holdings PLC	STK	5.057	0	0	GBP	5,215	31.104,87	0,05
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.	STK	2.838	0	0	EUR	11,895	33.758,01	0,06
NL0013654783	Prosus N.V.	STK	9.769	5.872	402	EUR	33,260	324.916,94	0,54
GB0007099541	Prudential PLC	STK	16.973	549	798	GBP	7,184	143.815,57	0,24
IT0004176001	Prysmian S.p.A.	STK	1.673	0	0	EUR	57,820	96.732,86	0,16
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK	1.537	119	0	EUR	99,380	152.747,06	0,25
NL0015001WV6	Qiagen N.V.	STK	1.512	1.512	0	EUR	38,550	58.287,60	0,10
AT0000606306	Raiffeisen Bank Intl AG	STK	801	801	0	EUR	16,220	12.992,22	0,02
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	709	0	0	EUR	42,330	30.011,97	0,05
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	4.641	330	296	GBP	42,820	234.390,07	0,39
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA	STK	559	0	0	EUR	48,700	27.223,30	0,05
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	2.371	0	0	EUR	16,320	38.694,72	0,06
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	11.885	751	979	GBP	36,390	510.108,10	0,85
FR0000131906	Renault S.A.	STK	1.209	0	0	EUR	47,840	57.838,56	0,10
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC	STK	15.365	0	0	GBP	4,612	83.580,09	0,14
IT0005282865	Reply S.p.A.	STK	139	139	141	EUR	137,800	19.154,20	0,03
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	7.671	1.041	1.608	EUR	14,735	113.032,19	0,19
FR0010451203	Rexel S.A.	STK	1.435	0	0	EUR	24,160	34.669,60	0,06
DK0010219153	Rockwool International A/S	STK	58	0	0	DKK	2.826,000	21.979,09	0,04
GB00BVFNZH21	Rotork PLC	STK	5.367	0	0	GBP	3,368	21.319,88	0,04
DK0060634707	Royal Unibrew AS	STK	255	0	0	DKK	552,000	18.875,08	0,03
GB0003096442	RS Group PLC	STK	2.851	0	0	GBP	7,010	23.571,99	0,04
FR0013269123	Rubis S.C.A.	STK	589	0	0	EUR	26,260	15.467,14	0,03
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings PLC	STK	3.329	0	0	EUR	16,330	54.362,57	0,09
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The	STK	6.407	0	0	GBP	10,885	82.255,35	0,14
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.	STK	10.873	0	0	GBP	2,550	32.701,72	0,05
NO0010310956	Salmar ASA	STK	442	0	0	NOK	562,000	21.767,87	0,04
FI4000552500	Sampo OYJ	STK	3.067	3.216	149	EUR	40,100	122.986,70	0,20
SE0000667891	Sandvik AB	STK	6.996	1.136	893	SEK	212,400	130.920,74	0,22
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	7.235	397	318	EUR	89,940	650.715,90	1,08
PLBZ00000044	Santander Bank Polska S.A.	STK	204	204	0	PLN	541,200	25.624,88	0,04
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.	STK	170	29	0	EUR	153,300	26.061,00	0,04
CH0024638196	Schindler Holding AG	STK	281	50	0	CHF	225,800	65.884,22	0,11
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	3.594	177	155	EUR	224,300	806.134,20	1,34
GB00BP9LHF23	Schroders PLC	STK	5.985	0	0	GBP	3,638	25.680,76	0,04
FR0010411983	SCOR SE	STK	922	0	0	EUR	23,660	21.814,52	0,04
FR0000121709	SEB S.A.	STK	149	0	0	EUR	95,600	14.244,40	0,02
SE0000163594	Securitas AB	STK	2.944	0	0	SEK	105,200	27.287,12	0,05
GB00B5ZM1N88	Segro PLC	STK	7.812	832	783	GBP	8,982	82.759,19	0,14
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC	STK	1.601	0	0	GBP	23,800	44.941,68	0,07
CH1256740924	SGS S.A.	STK	912	0	0	CHF	80,000	75.759,31	0,13

GB00BP6MXD84	Shell PLC	STK	40.261	42.561	2.300	EUR	33,595	1.352.568,30	2,25
CH0435377954	SIG Group AG	STK	1.886	257	446	CHF	16,450	32.215,05	0,05
NL0011821392	Signify N.V.	STK	853	0	0	EUR	23,300	19.874,90	0,03
CH0418792922	Sika AG	STK	939	89	61	CHF	257,200	250.777,01	0,42
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	10.160	0	0	SEK	156,500	140.091,63	0,23
SE0000113250	Skanska AB	STK	2.474	0	0	SEK	190,800	41.589,36	0,07
SE0000108227	SKF AB	STK	2.017	0	0	SEK	212,800	37.816,53	0,06
GB0009223206	Smith & Nephew PLC	STK	5.444	0	0	GBP	9,806	62.963,80	0,10
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC	STK	2.127	307	468	GBP	17,050	42.773,31	0,07
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC	STK	1.553	0	0	EUR	41,600	64.604,80	0,11
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	13.344	0	0	EUR	4,131	55.124,06	0,09
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	5.055	0	0	EUR	21,920	110.805,60	0,18
FR0000121220	Sodexo S.A.	STK	481	0	0	EUR	84,000	40.404,00	0,07
GB00BYZDVK82	Softcat PLC	STK	827	827	805	GBP	18,170	17.723,17	0,03
FR0013227113	Soitec S.A.	STK	153	0	0	EUR	104,200	15.942,60	0,03
CH0012549785	Sonova Holding AG	STK	299	0	0	CHF	277,600	86.187,01	0,14
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A.	STK	97	0	0	EUR	181,100	17.566,70	0,03
GB0003308607	Spectris PLC	STK	671	0	0	GBP	27,800	22.001,30	0,04
FR0012757854	Spie S.A.	STK	922	0	0	EUR	33,780	31.145,16	0,05
GB00BWFVGN14	Spirax-Sarco Engineering PLC	STK	462	0	0	GBP	84,800	46.208,17	0,08
SE0000120669	SSAB AB	STK	3.795	0	0	SEK	57,560	19.245,83	0,03
GB0007908733	SSE PLC	STK	6.825	299	317	GBP	17,895	144.050,69	0,24
GB0007669376	St. James's Place PLC	STK	3.123	0	0	GBP	5,465	20.129,98	0,03
GB0004082847	Standard Chartered PLC	STK	13.492	14	1.316	GBP	7,160	113.938,46	0,19
NL00150001Q9	Stellantis N.V.	STK	13.645	586	1.653	EUR	18,470	252.023,15	0,42
NL0000226223	STMicroelectronics N.V.	STK	4.054	186	378	EUR	36,875	149.491,25	0,25
FI0009005961	Stora Enso Oyj	STK	3.915	0	0	EUR	12,755	49.935,83	0,08
NO0003053605	Storebrand ASA	STK	2.758	0	0	NOK	109,000	26.343,78	0,04
CH1175448666	Straumann Holding AG	STK	702	0	0	CHF	111,300	81.130,37	0,14
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB	STK	3.333	0	0	SEK	156,550	45.971,91	0,08
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB	STK	9.584	1.422	2.027	SEK	100,950	85.242,71	0,14
CH0012255151	Swatch Group AG, The	STK	210	41	0	CHF	184,050	40.133,43	0,07
SE0014960373	Sweco AB	STK	1.237	0	0	SEK	145,400	15.846,68	0,03
SE0000242455	Swedbank AB	STK	5.491	0	0	SEK	218,100	105.514,28	0,18
SE0000872095	Swedish Orphan Biovitrum AB	STK	1.296	164	0	SEK	283,600	32.382,87	0,05
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	190	6	0	CHF	660,600	130.329,68	0,22
CH0008038389	Swiss Prime Site AG	STK	448	0	0	CHF	85,200	39.634,08	0,07
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	1.884	211	135	CHF	111,500	218.125,75	0,36
CH0008742519	Swisscom AG	STK	152	0	0	CHF	505,500	79.784,02	0,13
CH0010675863	Swissquote Grp Holding S.A.	STK	69	94	25	CHF	283,600	20.319,19	0,03
GB00BP92CJ43	Tate & Lyle PLC	STK	2.531	2.531	0	GBP	5,980	17.851,48	0,03
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC	STK	21.943	0	0	GBP	1,422	36.789,49	0,06
CH0012100191	Tecan Group AG	STK	76	0	0	CHF	300,800	23.737,92	0,04
NL0014559478	Technip Energies N.V.	STK	1.109	2.358	1.249	EUR	20,940	23.222,46	0,04
SE0005190238	Tele2 AB	STK	4.117	1.131	19	SEK	106,700	38.703,43	0,06
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A.	STK	61.930	0	0	EUR	0,224	13.841,36	0,02
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics.	STK	19.016	4.136	3.500	SEK	65,800	110.242,54	0,18
ES0178430E18	Telefónica S.A.	STK	32.158	1.514	5.326	EUR	3,960	127.345,68	0,21
FR0000051807	Téléperformance SE	STK	376	41	43	EUR	98,340	36.975,84	0,06
SE0000667925	Telia Company AB	STK	13.378	0	0	SEK	28,430	33.509,83	0,06
CH0012453913	Temenos AG	STK	492	131	131	CHF	62,000	31.674,37	0,05
LU2598331598	Tenaris S.A.	STK	2.921	2.921	0	EUR	14,350	41.916,35	0,07
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA	STK	8.902	0	0	EUR	7,218	64.254,64	0,11
GB00BLGZ9862	Tesco PLC	STK	42.515	0	2.626	GBP	3,060	153.442,12	0,26
SE0006422390	Thule Group AB (publ)	STK	824	0	0	SEK	278,000	20.182,56	0,03
FI0009000277	TietoEVRY Oyj	STK	577	0	0	EUR	18,040	10.409,08	0,02
NO0012470089	Tomra Systems ASA	STK	1.491	0	0	NOK	127,400	16.645,79	0,03
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	15.041	731	1.267	EUR	62,330	937.505,53	1,56
GB00BK9RKT01	Travis Perkins PLC	STK	1.370	0	0	GBP	7,690	12.425,90	0,02
SE0000114837	Trelleborg AB	STK	1.308	0	167	SEK	412,400	47.525,92	0,08
GB00BG49KP99	Tritax Big Box REIT PLC	STK	14.177	0	0	GBP	1,551	25.934,46	0,04
DK0060636678	Tryg AS	STK	2.127	0	0	DKK	152,200	43.410,20	0,07
FR0000054470	Ubisoft Entertainment S.A.	STK	581	0	0	EUR	20,440	11.875,64	0,02
CH0244767585	UBS Group AG	STK	20.189	3.149	1.868	CHF	26,450	554.487,36	0,92
BE0003739530	UCB S.A.	STK	822	80	68	EUR	138,700	114.011,40	0,19
BE0974320526	Umicore S.A.	STK	1.263	0	0	EUR	14,030	17.719,89	0,03
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE	STK	634	101	0	EUR	73,520	46.611,68	0,08
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	10.554	458	2.044	EUR	34,605	365.221,17	0,61
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	15.889	983	1.541	GBP	43,450	814.267,91	1,36
IT0004810054	Unipol Gruppo S.p.A.	STK	2.460	2.460	0	EUR	9,280	22.828,80	0,04
GB0006928617	Unite Group PLC	STK	2.234	0	0	GBP	8,920	23.503,31	0,04
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC	STK	4.342	0	0	GBP	9,826	50.320,80	0,08
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.	STK	3.184	0	163	EUR	32,620	103.862,08	0,17
FR0013176526	Valéo S.E.	STK	1.231	0	0	EUR	9,938	12.233,68	0,02
FR0013506730	Vallourec S.A.	STK	1.010	1.427	417	EUR	14,645	14.791,45	0,02
FI4000074984	Valmet Oyj	STK	972	0	0	EUR	26,690	25.942,68	0,04
CH0311864901	VAT Group AG	STK	166	166	0	CHF	509,400	87.804,79	0,15
FR0000124141	Veolia Environnement S.A.	STK	4.576	384	0	EUR	27,920	127.761,92	0,21
FR0013447729	Verallia SA	STK	463	0	0	EUR	33,880	15.686,44	0,03
AT0000746409	Verbund AG	STK	464	126	136	EUR	73,650	34.173,60	0,06
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS	STK	6.219	0	0	DKK	161,250	134.471,40	0,22
ES0183746314	Vidrala S.A.	STK	157	7	0	EUR	105,200	16.516,40	0,03
FR0000125486	VINCI S.A.	STK	3.725	238	207	EUR	98,380	366.465,50	0,61
GB00BD6GN030	Virgin Money UK PLC	STK	8.829	0	0	GBP	2,136	22.243,01	0,04
ES0184262212	Viscofan S.A.	STK	228	0	0	EUR	61,500	14.022,00	0,02
GB0001859296	Vistry Group PLC	STK	1.939	0	0	GBP	11,830	27.054,75	0,05
FR0000127771	Vivendi S.A.	STK	4.079	0	0	EUR	9,756	39.794,72	0,07
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC	STK	142.111	0	0	GBP	0,698	116.927,09	0,19
AT0000937503	voestalpine AG	STK	918	254	0	EUR	25,220	23.151,96	0,04
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	9.793	575	694	SEK	271,100	233.910,33	0,39
SE0021628898	Volvo Car AB	STK	6.096	6.096	0	SEK	32,785	17.608,58	0,03
SE0017780133	Wallenstam AB	STK	4.403	4.403	0	SEK	50,350	19.532,25	0,03
BE0974349814	Warehouses De Pauw N.V.	STK	956	0	0	EUR	25,300	24.186,80	0,04
FI0009003727	Wärtsilä Corp.	STK	3.353	956	1.032	EUR	18,000	60.354,00	0,10
GB0009465807	Weir Group PLC, The	STK	1.594	0	0	EUR	19,840	37.300,18	0,06
FR0000121204	Wendel SE	STK	158	0	0	EUR	82,600	13.050,80	0,02
GB00B1KJ408	Whitbread PLC	STK	1.204	0	0	GBP	29,750	42.246,86	0,07
AT0000831706	Wienerberger AG	STK	647	0	185	EUR	30,960	20.031,12	0,03

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
						EUR		50.865.575,44	84,78
Andere Wertpapiere									
Ausland									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	4.450	323	268	CHF	249,500	1.152.873,68	1,92
						EUR		1.152.873,68	1,92
						EUR		59.415.406,83	99,04
Summe Wertpapiervermögen									
Derivate									
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)									
Aktienindex-Derivate									
Forderungen/Verbindlichkeiten									
Aktienindex-Terminkontrakte									
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
Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds									
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle	EUR		221.273,37			%	100,000	221.273,37	0,37
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen									
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
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen									
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
Sonstige Vermögensgegenstände									
Dividendenforderungen Aktien	EUR		9.909,82			EUR		341.138,59	0,57
Dividendenforderungen Aktien	GBP		29.141,47					9.909,82	0,02
Dividendenforderungen Aktien	USD		20.844,69					34.371,02	0,06
Dividendenforderungen REITS	GBP		1.275,26					19.449,21	0,03
Initial Margin	EUR		19.836,40					1.504,11	0,00
Quellensteuererstattungsansprüche	CHF		209.756,58					19.836,40	0,03
Quellensteuererstattungsansprüche	DKK		128.618,20					217.804,45	0,36
Quellensteuererstattungsansprüche	EUR		18.927,28					17.246,94	0,03
Quellensteuererstattungsansprüche	PLN		759,51					18.927,28	0,03
Variation Margin	EUR		1.850,00					176,28	0,00
								1.850,00	0,00
Sonstige Verbindlichkeiten									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung	EUR		-27.552,30			EUR		-27.552,30	-0,05
								-27.552,30	-0,05
Wert des Teilsongermögens									
Anteilwert									
Umlaufende Anteile									
						EUR		59.994.114,71	100,00 ¹⁾
						EUR		52,97	
						STK		1.132.702	

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
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	
Ausland					
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 ¹⁾ EUR
I. Erträge			
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
Summe der Erträge		1.730.261,97	1,528
II. Aufwendungen			
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
Summe der Aufwendungen		-104.956,18	-0,093
III. Ordentlicher Nettoertrag		1.625.305,79	1,435
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		1.112.308,15	0,982
2. Realisierte Verluste		-488.748,58	-0,431
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		623.559,57	0,551
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		2.248.865,36	1,985
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		5.637.225,53	4,977
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		-453.599,51	-0,400
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		5.183.626,02	4,576
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		7.432.491,38	6,562

Entwicklung des Teilsondervermögens

	EUR	EUR
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		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	
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		59.994.114,71

Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		8.725.594,71	7,703
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 ²⁾		0,00	0,000
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		7.105.830,85	6,273
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		7.105.830,85	6,273
III. Gesamtausschüttung		1.619.763,86	1,430
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	Teilsondervermøge 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)

Anteilwert	EUR	DE000ETF9603
Umlaufende Anteile	STK	52,97
Anleger		1.132.702
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

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

	EUR	104.069,73
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"/>	Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="radio"/>	Nein
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt Es _____ an nachhaltigen Investitionen 70,97 %
<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"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: _____	<input checked="" type="checkbox"/>	mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: _____	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



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

Das Teilsondervermögen förderte ökologische und/oder soziale Merkmale durch die Verwendung des 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:

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
STOXX Europe 600 ESG+	76,22	99,79%

● **... 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 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 CO₂-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 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 & Halbleiterausstattung	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 %

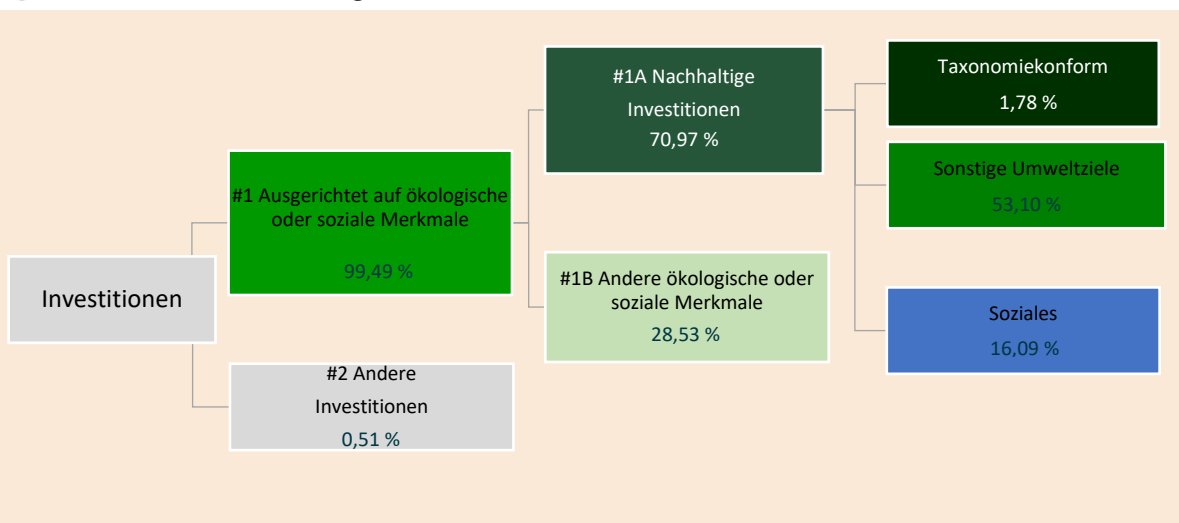
ELECT SE				
SANOFI	Gesundheit	Pharma Biotech & Life Sciences	Frankreich	1,09 %

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 & Tabak</i>	<i>5,77 %</i>
<i>IT</i>	<i>Halbleiter & 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 & Komponenten</i>	<i>2,52 %</i>
<i>Kommunikationsdienste</i>	<i>Telekommunikationsdienste</i>	<i>2,31 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Consumer Discretionary Distribution & 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 & Unterhaltung</i>	<i>0,82 %</i>
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	<i>Consumer Staples Distribution & Retail</i>	<i>0,79 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Metalle & 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 & 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 Kernenergie¹ investiert?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

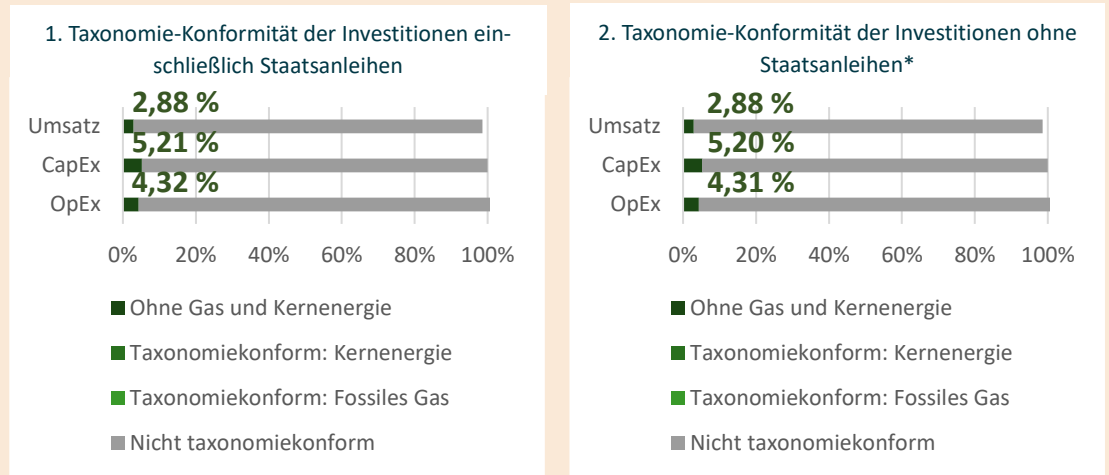
Verlässige Daten zur Angleichung an die EU-Taxonomie für fossiles Gas und Kernenergie waren im Berichtszeitraum nicht verfügbar.

¹Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels (Klimaschutz¹) 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 CO₂-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.

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
STOXX Europe 600 ESG+	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
Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF	14,15%
STOXX Europe 600 ESG+	14,02%
Spread	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
Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF	14,15%
STOXX Europe 600	10,71%
Spread	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
I. Vermögensgegenstände		277.760.256,16	100,04
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
II. Verbindlichkeiten		-114.424,15	-0,04
III. Teilsondervermögen		277.652.160,01	100,00 ¹⁾

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

Amundi DAX 50 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 im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondersvermögens	
Börsengehandelte Wertpapiere										
Aktien										
Inland										
DE000A1EWWW0	adidas AG	STK		47.563	24.399	21.244	EUR 223,000	10.606.549,00	3,82	
DE0008404005	Allianz SE	STK		75.612	32.436	44.807	EUR 259,500	19.621.314,00	7,07	
DE0006766504	Aurubis AG	STK		9.003	4.505	3.629	EUR 73,250	659.469,75	0,24	
DE000BASF111	BASF SE	STK		255.294	129.512	114.685	EUR 45,185	11.535.459,39	4,15	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG	STK		85.310	42.916	38.184	EUR 88,380	7.539.697,80	2,72	
DE0005200000	Beiersdorf AG	STK		27.656	13.981	12.689	EUR 136,550	3.776.426,80	1,36	
DE000A1DAH00	Brenntag SE	STK		36.880	16.056	18.072	EUR 62,960	2.321.964,80	0,84	
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG	STK		10.453	5.282	4.675	EUR 65,650	686.239,45	0,25	
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK		282.981	146.836	148.636	EUR 14,185	4.014.085,49	1,45	
DE0005439004	Continental AG	STK		30.893	15.664	13.873	EUR 52,900	1.634.239,70	0,59	
DE0006062144	Covestro AG	STK		54.061	27.182	24.159	EUR 54,800	2.962.542,80	1,07	
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG	STK		164.753	87.531	69.619	EUR 37,170	6.123.869,01	2,21	
DE0005140008	Deutsche Bank AG	STK		570.558	279.829	258.801	EUR 14,908	8.505.878,66	3,06	
DE0005810055	Deutsche Börse AG	STK		54.347	28.689	23.844	EUR 191,100	10.385.711,70	3,74	
DE0005552004	Deutsche Post AG	STK		284.927	152.566	120.419	EUR 37,790	10.767.391,33	3,88	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG	STK		860.159	425.777	495.979	EUR 23,480	20.196.533,32	7,27	
DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG	STK		31.530	16.005	15.442	EUR 69,520	2.191.965,60	0,79	
DE000EVNK013	Evonik Industries AG	STK		71.285	42.638	26.596	EUR 19,050	1.357.979,25	0,49	
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA	STK		56.928	28.816	25.510	EUR 35,760	2.035.745,28	0,73	
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA	STK		118.574	60.091	53.206	EUR 27,880	3.305.843,12	1,19	
DE0006602006	GEA Group AG	STK		44.955	24.774	19.102	EUR 38,900	1.748.749,50	0,63	
DE0008402215	Hannover Rück SE	STK		17.172	8.712	7.715	EUR 236,700	4.064.612,40	1,46	
DE0006047004	Heidelberg Materials AG	STK		38.726	19.061	17.449	EUR 96,820	3.749.451,32	1,35	
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA	STK		46.584	23.611	20.896	EUR 83,220	3.876.720,48	1,40	
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG	STK		17.026	8.834	7.471	EUR 41,770	711.176,02	0,26	
DE0006231004	Infineon Technologies AG	STK		373.541	193.514	170.837	EUR 34,305	12.814.324,01	4,62	
DE000KSAG888	K+S Aktiengesellschaft	STK		51.229	57.289	6.060	EUR 12,575	644.204,68	0,23	
DE000KGX8881	KION GROUP AG	STK		20.070	10.154	8.960	EUR 39,090	784.536,30	0,28	
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG	STK		18.909	9.548	8.450	EUR 71,300	1.348.211,70	0,49	
DE0005470405	LANXESS AG	STK		24.698	14.272	10.425	EUR 22,980	567.560,04	0,20	
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE	STK		21.198	10.746	9.515	EUR 76,260	1.616.559,48	0,58	
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG	STK		211.516	115.469	117.108	EUR 64,570	13.657.588,12	4,92	
DE0006599905	Merck KGaA	STK		36.968	18.762	16.615	EUR 154,750	5.720.798,00	2,06	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG	STK		38.260	19.479	17.987	EUR 467,000	17.867.420,00	6,44	
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE	STK		43.799	20.394	19.852	EUR 42,210	1.848.755,79	0,67	
DE0006969603	PUMA SE	STK		30.199	16.126	13.068	EUR 42,870	1.294.631,13	0,47	
DE0007164600	SAP SE	STK		108.885	53.393	93.211	EUR 189,520	20.635.885,20	7,43	
DE0007165631	Sartorius AG	STK		7.214	3.750	3.164	EUR 219,000	1.579.866,00	0,57	
DE000A12DM80	Scout24 AG	STK		21.453	10.839	9.506	EUR 71,200	1.527.453,60	0,55	
DE0007236101	Siemens AG	STK		113.436	74.178	76.513	EUR 173,720	19.706.101,92	7,10	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK		189.513	116.854	72.103	EUR 24,310	4.607.061,03	1,66	
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG	STK		79.533	40.380	35.761	EUR 53,800	4.278.875,40	1,54	
DE000SYM9999	Symrise AG	STK		35.954	18.237	16.164	EUR 114,300	4.109.542,20	1,48	
DE000TLX1005	Talanx AG	STK		17.181	9.871	7.120	EUR 74,550	1.280.843,55	0,46	
DE0007500001	thyssenkrupp AG	STK		140.798	75.103	66.926	EUR 4,038	568.542,32	0,20	
DE0007664039	Volkswagen AG	STK		58.982	29.927	26.502	EUR 105,400	6.216.702,80	2,24	
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK		200.650	106.380	88.847	EUR 26,550	5.327.257,50	1,92	
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG	STK		5.643	7.348	1.705	EUR 101,800	574.457,40	0,21	
DE000ZAL1111	Zalando SE	STK		67.869	34.893	29.959	EUR 21,890	1.485.652,41	0,54	
								EUR	274.442.446,55	98,84
Ausland										
NL0015001WM6	Qiagen N.V.	STK		64.045	72.816	8.771	EUR 38,550	2.468.934,75	0,89	
								EUR	2.468.934,75	0,89
Summe Wertpapiervermögen								EUR	276.911.381,30	99,73
Derivate										
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)										
								1.578,50	0,00	
Aktienindex-Derivate										
Forderungen/Verbindlichkeiten										
Aktienindex-Terminkontrakte										
DAX INDEX 20/09/2024	EUREX	EUR		Anzahl 1				32,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024	EUREX	EUR		Anzahl 24				912,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024	EUREX	EUR		Anzahl 9				351,00	0,00	
DAX INDEX 20/09/2024	EUREX	EUR		Anzahl 7				283,50	0,00	
Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds										
EUR-Guthaben bei:								EUR	797.051,76	0,29
Verwahrstelle		EUR		781.791,67			% 100,000	781.791,67	0,28	
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen										
Verwahrstelle		USD		16.355,00			% 100,000	15.260,09	0,01	
Sonstige Vermögensgegenstände										
Initial Margin		EUR		54.965,10			EUR	56.572,60	0,02	
Variation Margin		EUR		1.607,50				54.965,10	0,02	
								1.607,50	0,00	
Sonstige Verbindlichkeiten										
Verbindlichkeiten Futures		EUR		-6.321,16			EUR	-114.424,15	-0,04	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR		-108.102,99				-6.321,16	0,00	
								-108.102,99	-0,04	
Wert des Teilsondervermögens Anteilwert								EUR	277.652.160,01	100,00 ¹⁾
								EUR	40,14	

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
Börsengehandelte Wertpapiere					
Aktien					
Inland					
DE000BAY0017	Bayer AG	STK	4.059	268.750	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG	STK	86.121	321.739	
Ausland					
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	0	61.439	
Derivate (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)					
Terminkontrakte					
Aktienindex-Terminkontrakte					
Gekaufte Kontrakte					
(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 ¹⁾ EUR
I. Erträge			
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
Summe der Erträge		7.993.240,20	1,156
II. Aufwendungen			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-0,50	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-386.864,53	-0,056
Summe der Aufwendungen		-386.865,03	-0,056
III. Ordentlicher Nettoertrag		7.606.375,17	1,100
IV. Veräußerungsgeschäfte			
1. Realisierte Gewinne		11.578.569,21	1,674
2. Realisierte Verluste		-10.235.798,50	-1,480
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften		1.342.770,71	0,194
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		8.949.145,88	1,294
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		18.186.274,40	2,629
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		6.187.096,55	0,895
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		24.373.370,95	3,524
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres		33.322.516,83	4,818

Entwicklung des Teilsondervermögens

	EUR	EUR	2023 / 2024
I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		EUR	
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		264.525.725,78	
2. Mittelzufluss (netto)		-8.890.843,10	
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	100.307.247,31	-12.329.507,75	
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		
II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		277.652.160,01	

Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil ¹⁾ EUR
I. Für die Ausschüttung verfügbar		41.023.753,25	5,931
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 ²⁾		0,00	0,000
II. Nicht für die Ausschüttung verwendet		33.415.348,05	4,831
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		33.415.348,05	4,831
III. Gesamtausschüttung		7.608.405,20	1,100
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)

Anteilwert	EUR	DE000ETF9090
Umlaufende Anteile	STK	40,14
Anleger		6.916.732
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 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	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 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 Aufwendererstattungen.

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

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
DAX 50 ESG	77,49	100%

● **... 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 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 CO₂-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 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**

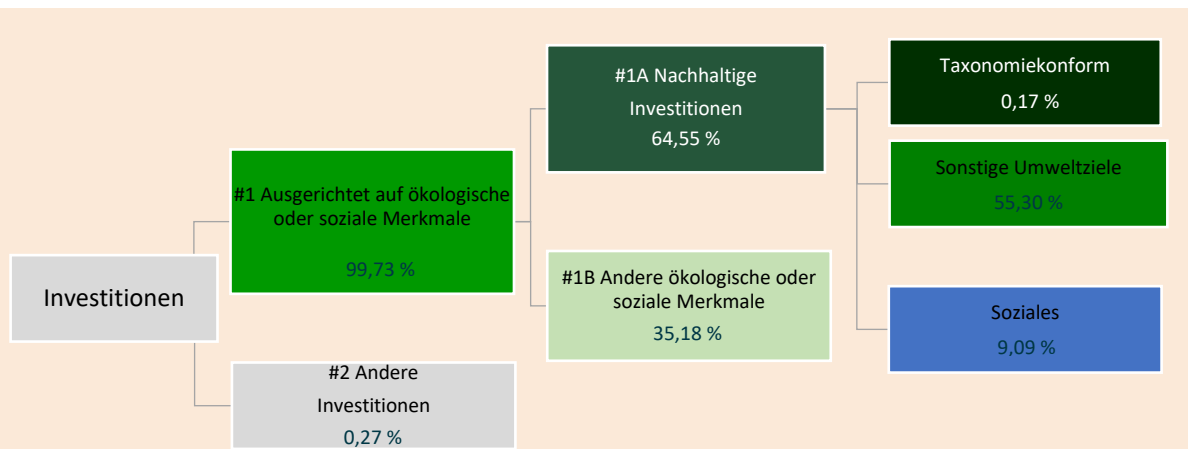
Größte Investitionen	Sektor	TeilSektor	Land	In % der Vermögenswerte
SAP SE / XETRA	IT	IT-Software und -Services	Deutschland	7,43 %
DEUTSCHE TELEKOM NAM (XETRA)	Kommunikationsdienste	Telekommunikationsdienste	Deutschland	7,27 %
SIEMENS AG-REG	Industrie	Investitionsgüter	Deutschland	7,10 %
ALLIANZ SE-REG	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 & Halbleiterausstattung	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?

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
<i>Finanzwesen</i>	<i>Versicherungen</i>	15,43 %
<i>Industrie</i>	<i>Investitionsgüter</i>	13,20 %
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Automobile & 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 & 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 & 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 & Unterhaltung</i>	<i>0,55 %</i>
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	<i>Consumer Discretionary Distribution & Retail</i>	<i>0,54 %</i>
<i>Grundstoffe</i>	<i>Metalle & 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 Kernenergie¹ investiert?**

Ja:

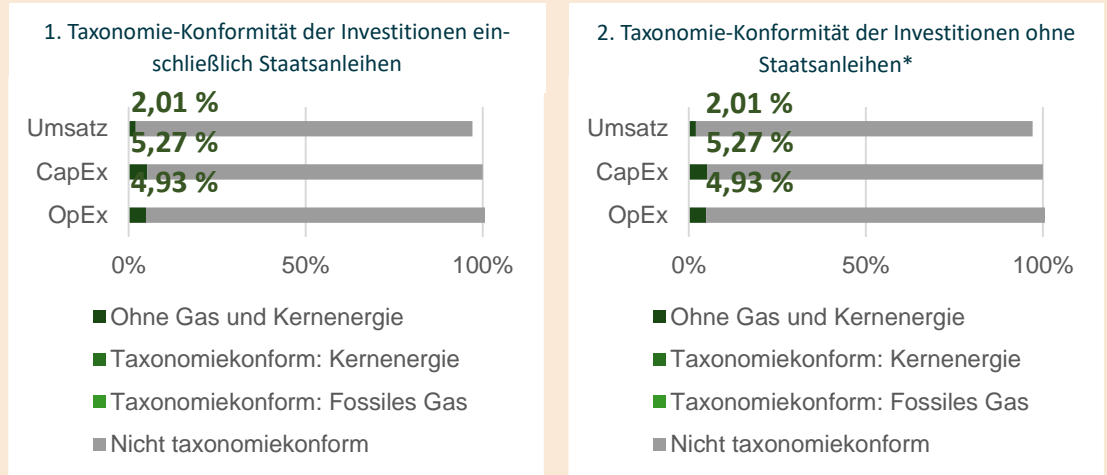
In fossiles Gas In Kernenergie

Nein

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

¹Tätigkeiten 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 CO₂-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.

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
DAX 50 ESG	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
Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF	12,68%
DAX 50 ESG	13,36%
Spread	-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
Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF	12,68%
HDAX Index	10,54%
Spread	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