

Amundi Luxembourg S.A.  
(vormals: Lyxor Funds Solutions S.A.)  
Luxemburg

Testatsexemplar

OGAW

Umbrella-Konstruktion Amundi (vormals: Lyxor 1)

Jahresbericht zum 30. Juni 2023

Ernst & Young GmbH

Wirtschaftsprüfungsgesellschaft



Inhaltsverzeichnis

Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

Jahresbericht

Auftragsbedingungen, Haftung und Verwendungsvorbehalt

Allgemeine Auftragsbedingungen

Hinweis:

Den nachfolgenden Vermerk haben wir, unter Beachtung der gesetzlichen und berufsständischen Bestimmungen, nach Maßgabe der in der Anlage "Auftragsbedingungen, Haftung und Verwendungsvorbehalt" beschriebenen Bedingungen erteilt.



Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die Amundi Luxembourg S.A.

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresberichte der Teilsondervermögen Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF), Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF), Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF), Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF) und Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF) der Umbrella-Konstruktion Amundi (vormals: Lyxor 1) – bestehend aus dem zusammengefassten Tätigkeitsbericht für die Teilsondervermögen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023, den Vermögensübersichten und den Vermögensaufstellungen zum 30. Juni 2023, den Ertrags- und Aufwandsrechnungen, den Verwendungsrechnungen, den Entwicklungsrechnungen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023, 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.

## 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 Investmentvermögen 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.

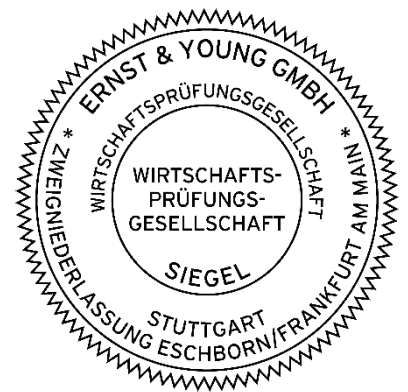
Wir erörtern mit den für die Überwachung Verantwortlichen u.a. den geplanten Umfang und die Zeitplanung der Prüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich etwaiger Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen.

Eschborn/Frankfurt am Main, 14. November 2023

Ernst & Young GmbH  
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Heist  
Wirtschaftsprüfer

Lattwein  
Wirtschaftsprüfer



# Amundi (vormals: Lyxor 1)

## Zusammengefasster Tätigkeitsbericht für die Teilsondervermögen

**Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF),**

**Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF),**

**Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF),**

**Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF) und**

**Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) 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 (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF) - Wertentwicklung des MDAX® ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index)

Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF) - Wertentwicklung des DivDAX® Index (Performance-Index)

Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF) - Wertentwicklung des TecDAX® (Performance-Index)

Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF) - Wertentwicklung des STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index

Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF) - Wertentwicklung des DAX® 50 ESG (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 Tracking Error kommen.

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

### Wesentliche Trends im Berichtszeitraum:

#### Q3 2022

Der MSCI World AC fiel in diesem Quartal um -5,3 % ab. Vom 1. Juli bis 16. August legte der Index um über 12 % zu, bevor er seine Gewinne wieder abgab. Diese ziemlich starken Bewegungen hängen teilweise mit dem Rückgang der Langfristzinsen im Juli und der vorzeitigen Erwartung eines „Pivot“ durch die Fed zusammen. Darüber hinaus trugen hervorragende Quartalsergebnisse der Unternehmen im zweiten Quartal zur Sommerrallye bei. Doch der aggressivere Ton der Zentralbanken sowie die Turbulenzen an den Devisenmärkten im September ließen die Aktienmärkte einbrechen. Im Laufe des Quartals schnitt Europa auf regionaler Ebene in lokalen Währungen am besten ab (-4,6 %), gefolgt von den USA (-5,1 %) und dann den Schwellenländern (-9,1 %). Innerhalb der Region schnitt die Eurozone (-4,7 %) etwas schlechter ab als das Vereinigte Königreich (-4,1 %) und Schweden (-1,3 %). Es ist zu beachten, dass der chinesische Markt in diesem Quartal stark gelitten hat (-22,3 %). In Europa schnitten zyklische Sektoren besser ab als defensive. Der Energiesektor (+2,1 %) lag an der Spitze, gefolgt von Basiskonsumgütern (-2,7 %). Der Technologiesektor (-2,9 %) profitierte vom Rückgang der Langfristzinsen in diesem Sommer und positiven Quartalsergebnissen. Andererseits traf der starke Zinsanstieg im September besonders den Immobiliensektor (-17,5 %). Besonders stark litten Kommunikationsdienste (-14,3 %) und das Gesundheitswesen (-8,6 %) weiterhin auf der defensiven Seite. Insgesamt übertrafen die Wachstumsaktien (-3,3 %) die Value-Aktien (-5,8 %).

#### Q4 2022

Risikoreiche Anlagen erholten sich in diesem Quartal und profitierten von mehreren Faktoren: einer entgegenkommenderen Haltung der US-Notenbank, beruhigenden Quartalsergebnissen und einem starken Rückgang der Anleiherenditen. Der MSCI World AC legte um +7,0 % zu. Der MSCI EMU lag in diesem Quartal an der Spitze (+12,5 %) und übertraf den MSCI USA (+6,6 %). Die Märkte der Eurozone übertrafen den MSCI Europe (+10,1 %), wobei Schweden (+10,6 %) in diesem Quartal den größten Beitrag leistete, gefolgt vom Vereinigten Königreich (+7,9 %) und der Schweiz (+3,8 %). Unter den entwickelten Ländern schnitt Japan immer noch schlechter ab als seine Pendants, blieb aber im positiven Bereich (+3,0 %). Der MSCI Emerging Markets schnitt in diesem Quartal im grünen Bereich ab (+6,1 %), was der starken Korrektur des Dollars im November entspricht. Auf Sektorebene befinden sich alle europäischen Sektoren im positiven Bereich. Zyklische Sektoren übertrafen die sogenannten „defensiven“ Sektoren. Spitzenreiter sind Banken (+17,6 %), gefolgt von Versicherungen (+16,7 %) und Finanzen (+15,5 %). Der Kommunikationsdienstleistungssektor schloss das Quartal mit einer gemischten, aber positiven Leistung von +1,6 % ab. Value-Aktien (+12,4 %) übertrafen in diesem Quartal Wachstumsaktien (+7,8 %).

#### Q1 2023

Dank eines guten Januar legten die Aktienmärkte im ersten Quartal zu. Eine kräftige Erholung im Januar, wobei Aktien durch sinkende Zinsen und ermutigende Wirtschaftsdaten Auftrieb erhielten. Rückgang im Februar: Steigende Zinssätze wirkten sich dieses Mal negativ auf Aktien aus und lösten im März sogar eine Bankenpleite in den USA (SVB) aus, die groß genug war, um eine koordinierte und beruhigende Unterstützung durch die Fed, das Finanzministerium und die FDIC (Federal Deposit Insurance Corp.) auszulösen. Insgesamt stieg der MSCI World AC im ersten Quartal um weitere 6,5 %. Auf regionaler Ebene lag die Eurozone (+12,0 %) an der Spitze, unterstützt durch recht gute Ergebnisveröffentlichungen für das vierte Quartal 2022. Diese gute Leistung betrifft die meisten Länder der Zone: Niederlande (+14,5 %), Spanien (+13,4 %), Deutschland (+12,4 %), Frankreich (+12,4 %), Italien (+12,0 %). Portugal blieb hinter den Erwartungen zurück (+1,6 %). Der Rest Europas blieb hinter den Erwartungen zurück, insbesondere die Schweiz (+4,5 %) und das Vereinigte Königreich (+2,1 %). Aber insgesamt legte Europa um +8 % zu. Die beiden schwächsten Regionen im Quartal waren die USA (+7,3 %) und die Schwellenländer (+3,4 %), obwohl China um +5,0 % zulegen konnte. Bezogen auf die Sektoren entwickelten sich fast alle europäischen Sektoren positiv. Technologie (+20,4 %), zyklische Konsumgüter (+19,3 %), Kommunikationsdienste (+15,2 %) und Industrie (+12,6 %) verzeichneten allesamt starke Zuwächse. Die Sektoren Immobilien (-7,4 %) und Energie (-2,6 %) schlossen die Lücke auf. Value-Aktien (+4,8 %) schneiden jetzt schlechter ab als Wachstumsaktien (+11,2 %).

#### Q2 2023

Die Aktienmärkte erholten sich in diesem Quartal stark, da die Anleger auf die Widerstandsfähigkeit der Wirtschaft und die verschiedenen geldpolitischen Entscheidungen der Zentralbanken spekulierten. Darüber hinaus stützten starke vierteljährliche Unternehmensergebnisse die Aktienmärkte. Der MSCI World AC stieg um weitere +6 %. Auf regionaler Ebene übertrafen die Vereinigten Staaten (+8,3 %) Europa (+0,4 %) deutlich. Letztere festigte die hervorragende Leistung seit Jahresbeginn. Innerhalb der Eurozone (+1 %) schnitt Italien (+5,3 %) deutlich besser ab, gefolgt von Spanien (+3,6 %) und den Niederlanden (+2,9 %). Außerhalb der Eurozone verzeichnete der britische Markt einen Rückgang von -1,6 %. Schweden (+1,8 %) und die Schweiz (+0,8 %) liegen in diesem Quartal im positiven Bereich. Auch Japan (+15,4 %) in Landeswährung profitierte vom Rückgang des Yen, einer sich verbessernden Wirtschaft und ermutigenden Reformen der Unternehmensführung. Schließlich verzeichnete der MSCI Emerging Markets Index (+0,7 %) ein positives Ergebnis, trotz der erheblichen Underperformance des chinesischen Marktes (-9,9 %). In Bezug auf die europäischen Sektoren lag das Bankwesen (+6,2 %) an der Spitze, gefolgt von IT (+4,4 %) und dem verarbeitenden Gewerbe (+2,5 %). Kommunikationsdienstleistungen (-7,6 %), Materialien (-4,1 %) und Immobilien (-3,9 %) waren in diesem Quartal die größten Verlustbringer. Darüber hinaus entwickelten sich Value-Aktien (-0,5 %) schlechter als Wachstumsaktien (+1,3 %).

### Performance bekannter Aktienindizes:

MSCI World Preis-Index (in USD):	16,52 %
EuroStoxx 50 Preis-Index (in EUR):	27,33 %
DAX Performance-Index (in EUR):	26,32 %
Topix Preis-Index (in JPY):	22,33 %
S&P 500 Preis-Index (in USD):	17,57 %



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

Rohöl (Brent):	- 31,30 %
Kupfer:	+ 0,71 %
Gold:	+ 6,48 %

Der Euro wertete im Berichtszeitraum gegenüber dem US-Dollar auf (+4,11 %), was im Umkehrschluss dazu führte, dass Anlagen in US-Dollar im gleichen Umfang an Wert verloren. Der Euro wertete gegenüber dem japanischen Yen weiter auf (+10,67 %).

Am 30. Juni 2022 lag die Rendite 10-jähriger deutscher Staatsanleihen bei +1,34 %. Die Rendite dieser langfristigen Schuldtitel der Bundesrepublik Deutschland stieg im Betrachtungszeitraum deutlich um 105 Basispunkte auf +2,39 % zum 30. Juni 2023.

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

MDAX ESG+ (NR) EUR (Net Total Return Index):	9,97 %
DivDAX Performance-Index:	25,05 %
TecDAX Performance-Index:	11,01 %
DAX 50 ESG Performance-Index:	22,83 %
STOXX Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index:	16,69 %

#### **Performance der einzelnen Teilfonds**

Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF):	7,66 %
Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF):	23,48 %
Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF):	10,37 %
Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF) :	21,89 %
Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF):	16,89 %

Datenquelle: Bloomberg

#### **Wesentliche Risiken des 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 das 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.

#### **Nachhaltigkeitsrisiko:**

Gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Angaben im Finanzdienstleistungssektor (die "Offenlegungs-Verordnung") ist die Verwaltungsgesellschaft verpflichtet, die Art und Weise, in der Nachhaltigkeitsrisiken (wie nachstehend definiert) in ihre Investmententscheidungen einbezogen werden, sowie die Ergebnisse der Bewertung der wahrscheinlichen Auswirkungen von Nachhaltigkeitsrisiken auf die Rendite der Teilfonds offenzulegen. Die Auswirkungen nach dem Eintreten eines Nachhaltigkeitsrisikos können zahlreich sein und variieren je nach einem spezifischen anderen Risiko, einer Region und/oder einer Anlageklasse. Im Allgemeinen hat der Eintritt eines Nachhaltigkeitsrisikos für einen Vermögenswert negative Auswirkungen und möglicherweise einen Totalverlust seines Wertes und somit negative Auswirkungen auf den Nettoinventarwert des betreffenden Teilfonds zur Folge. Eine solche Bewertung der wahrscheinlichen Auswirkungen muss daher auf jeder Teilfondsebene durchgeführt werden; weitere Einzelheiten und spezifische Informationen sind im Besonderen Teil des jeweiligen Teilfonds enthalten.

"Nachhaltigkeitsfaktoren" bezeichnen Umwelt-, Sozial- und Arbeitnehmerbelange, Achtung der Menschenrechte sowie die Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

"Nachhaltigkeitsrisiko" bezeichnet ein Ereignis oder eine Bedingung im Bereich Umwelt, Soziales oder Unternehmensführung (ESG), das, wenn es eintritt, eine tatsächliche oder potenzielle wesentliche negative Auswirkung auf den Wert der Investitionen des betreffenden Teilfonds haben könnte. Nachhaltigkeitsrisiken können entweder ein eigenes Risiko darstellen oder sich auf andere Risiken auswirken und diese erheblich verstärken, wie z. B. unter anderem, aber nicht ausschließlich Marktrisiken, operationelle Risiken, Liquiditätsrisiken oder Kontrahentenrisiken. Die Bewertung von Nachhaltigkeitsrisiken ist komplex und kann auf ESG-Daten beruhen, die schwer zu beschaffen, unvollständig, geschätzt, veraltet und/oder anderweitig in wesentlichen Punkten ungenau sind. Selbst wenn diese Daten identifiziert werden, gibt es keine Garantie, dass sie korrekt bewertet werden.

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

#### Risikomanagement:

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

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

Die verwaltende Kapitalverwaltungsgesellschaft der Teilfonds änderte sich mit Wirkung zum 01.07.2022 von der Lyxor Funds Solutions S.A. in die Amundi Luxembourg S.A.

Die BNP Paribas Securities Services S.C.A. ist zum 1. Oktober 2022 auf die BNP Paribas S.A. verschmolzen. Daher geht die Verwahrstellenfunktion für die Teilfonds von der BNP Paribas Securities Services S.C.A, Zweigniederlassung Frankfurt auf die BNP Paribas S.A. Niederlassung Deutschland über.

Die von der Gesellschaft verwalteten Teilsondervermögen (die „Teilfonds“) der Umbrella-Konstruktion deutschen Rechts „Lyxor 1“ (der „Fonds“) wurden in „Amundi“ umbenannt. Die Änderungen traten am 5. Oktober 2023 in Kraft.

<b>Fonds-/Teilfondsbezeichnung alt</b>	<b>Fonds-/Teilfondsbezeichnung neu</b>	<b>ISIN</b>
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

Die folgenden Teilfonds wurden mit Wirkung zum 13. September 2022 aufgelöst:

Lyxor 1 EURO STOXX 50 (DR) UCITS ETF  
Lyxor 1 SDAX (DR) UCITS ETF

Zum 22. November 2022 fand ein Indexwechsel und eine daraus resultierende Namensänderung des Teilfonds Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF (vorher: Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF) statt. Der dem Teilfonds zuvor zugrundeliegende Index MDAX® wurde durch den MDAX® ESG+ (NR) EUR ersetzt. Hintergrund des Indexwechsels ist die Angebotsweiterung an Nachhaltigkeitsfonds der Gesellschaft. Seit dem Datum des Inkrafttretens des Indexwechsels bewirbt der Teilfonds ökologische und/oder soziale Aspekte im Sinne des Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor. Infolge des Indexwechsel und der Klassifizierung als „Artikel 8 Fonds“ gemäß Offenlegungsverordnung wurde der vorherige Name des Teilfonds Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF in Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF und die vorherige Bezeichnung der Anteilklasse Lyxor 1 MDAX (DR) UCITS ETF (I) in Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF Dist geändert.

Zum 06. Dezember 2022 wechselte die Portfoliomanagementfunktion aller Teilfonds von Amundi Deutschland GmbH zu Amundi Asset Management S.A.S.

#### 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 weitere Sanktionen verhängt.

Diese Situation, zusammen mit den zunehmenden Schwankungen von Rohstoffpreisen und Wechselkursen, hat zu einem starken Anstieg der Volatilität an den Märkten geführt. Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft sieht keine hieraus resultierende Notwendigkeit für die 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 (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF):

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

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

Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF)

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

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Position Arountown S.A).

Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF):

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

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von ausländischen Aktien (größte Position Varta AG).

Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF):

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

Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Credit Suisse Group 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 Linde Plc).  
Die wesentlichen Verluste resultieren aus dem Verkauf von inländischen Aktien (größte Position Position Arountown S.A

**Der Verwaltungsrat**

**Luxemburg, den 14. November 2023**

Anmerkung: Die Informationen in diesem Bericht beziehen sich auf historische Daten und haben keine Aussagekraft für die künftige Entwicklung des Investmentvermögens.

# Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF)

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>61.880.515,20</b>	<b>100,16</b>
1. Aktien		61.783.710,53	100,00
- Bau und Baustoffe	1.479.936,00		2,40
- Chemische Industrie	5.670.325,23		9,18
- Einzelhandel	1.704.174,12		2,76
- Energieversorger	3.333.799,04		5,40
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	16.906.075,24		27,36
- Pharmaindustrie / Biotech	5.939.334,72		9,61
- Real Estate	1.737.586,61		2,81
- Telekommunikation	6.450.390,23		10,44
- Transportation	5.995.519,74		9,70
- Versicherungen	12.566.569,60		20,34
2. Bankguthaben		96.804,67	0,16
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-96.408,98</b>	<b>-0,16</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>61.784.106,22</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

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

# Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF)

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsongersvermögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Inland</b>									
DE0008404005	Allianz SE		STK	29.150	10.933	6.160	EUR 213,200	6.214.780,00	10,06
DE000BASF111	BASF SE		STK	127.509	50.405	19.818	EUR 44,470	5.670.325,23	9,18
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	117.216	54.584	8.858	EUR 50,670	5.939.334,72	9,61
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	42.727	16.194	7.891	EUR 112,520	4.807.642,04	7,78
DE0005439004	Continental AG		STK	15.431	16.562	1.131	EUR 69,100	1.066.282,10	1,73
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	134.038	47.926	17.885	EUR 44,730	5.995.519,74	9,70
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	322.907	123.439	47.642	EUR 19,976	6.450.390,23	10,44
DE000ENAG999	E.ON SE		STK	285.428	104.388	42.438	EUR 11,680	3.333.799,04	5,40
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	19.680	6.940	2.475	EUR 75,200	1.479.936,00	2,40
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	23.262	24.972	1.710	EUR 73,260	1.704.174,12	2,76
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG		STK	83.416	102.105	18.689	EUR 73,670	6.145.256,72	9,95
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	18.486	6.223	2.787	EUR 343,600	6.351.789,60	10,28
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	22.937	8.501	2.014	EUR 55,160	1.265.204,92	2,05
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	29.459	14.621	7.314	EUR 122,940	3.621.689,46	5,86
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	97.099	34.871	14.829	EUR 17,895	1.737.586,61	2,81
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>							<b>EUR</b>	<b>61.783.710,53</b>	<b>100,00</b>
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>									
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle			EUR	96.804,67			% 100,000	96.804,67	0,16
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften			EUR	-58.530,61			EUR	-96.408,98	-0,16
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-37.878,37				-37.878,37	-0,06
<b>Wert des Teilsongersvermögens</b>							<b>EUR</b>	<b>61.784.106,22</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>189,14</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>STK</b>	<b>326.650</b>	

Fußnoten:

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

### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2023

Keine Fremdwährungskurse

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE0006062144	Covestro AG	STK	8.569	29.041	
DE0007037129	RWE AG	STK	8.839	81.483	
DE0007236101	Siemens AG	STK	5.251	48.406	
DE000A2GSYQ9	Vonovia SE - Anrechte	STK	101.354	101.354	

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		3.787.711,04	11,596
2. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		851,23	0,003
3. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-525.477,86	-1,609
4. Sonstige Erträge		600,74	0,002
davon: Sonstiges	600,74		0,002
<b>Summe der Erträge</b>		<b>3.263.685,15</b>	<b>9,991</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-139.190,13	-0,426
2. Sonstige Aufwendungen		-95,69	0,000
davon: Bankgebühren	-94,76		0,000
davon: Sonstiges	-0,93		0,000
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-139.285,82</b>	<b>-0,426</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>3.124.399,33</b>	<b>9,565</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		2.072.290,55	6,344
2. Realisierte Verluste		-1.618.315,96	-4,954
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>453.974,59</b>	<b>1,390</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>3.578.373,92</b>	<b>10,955</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		7.141.275,64	21,862
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		820.309,63	2,511
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>7.961.585,27</b>	<b>24,373</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>11.539.959,19</b>	<b>35,328</b>

**Entwicklung des Teilsongervermögens**

	2022 / 2023
	EUR
<b>I. Wert des Teilsongervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>42.874.805,30</b>
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-1.687.122,00
2. Mittelzufluss (netto)	9.081.082,05
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	10.538.687,47
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.457.605,42
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	-24.618,32
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	11.539.959,19
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	7.141.275,64
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	820.309,63
<b>II. Wert des Teilsongervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>61.784.106,22</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsongervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>11.398.058,53</b>	<b>34,894</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		7.819.684,61	23,939
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		3.578.373,92	10,955
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>8.307.949,53</b>	<b>25,434</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,00
2. Vortrag auf neue Rechnung		<b>8.307.949,53</b>	25,434
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>3.090.109,00</b>	<b>9,460</b>
1. Endausschüttung		3.090.109,00	9,460

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

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsongervermög am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2022/2023	61.784.106,22	189,14
2021/2022	42.874.805,30	159,59
2020/2021	46.522.692,09	195,10
2019/2020	34.557.898,72	155,81

# Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF)

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

### Sonstige Angaben

**Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF)**  
**International Security Identification Number (ISIN)**

<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>DE000ETF9033</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>189,14</b>
Anleger		<b>326.650</b>
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	Private Anleger
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Mindeststückelung	Anteil	5,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	1,00
Ertragsverwendung		0,25
		ausschüttend
<b>Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)</b>		<b>100,00</b>
<b>Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)</b>		<b>0,00</b>

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2023 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 30.06.2023 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	563,51
------------------------------------	-----	--------

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

Negative Einlagenzinsen	EUR	-85,87
-------------------------	-----	--------

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

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

**0,25**

#### 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 Aufwandsersatzungen, 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 vor Ertragsausgleich

<b>Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)</b>	<b>EUR</b>	<b>134.558,47</b>
---	------------	-------------------

Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	60,47
--	---	-------

Davon für die Verwahrstelle	%	23,69
-----------------------------	---	-------

Davon für Dritte	%	15,84
------------------	---	-------

#### Transaktionskosten

<b>EUR</b>	<b>2.340,04</b>
------------	-----------------

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 Aufwandsersatzungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,44%
--	-------

Höhe der Annual Tracking Difference	-1,56%
-------------------------------------	--------

Der im Geschäftsjahr 2022/2023 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

### 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.

### 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 2022 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 2022 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxemburg am 22. Juni 2022 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2022 fand am 01. Februar 2022 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 31.12.2022 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds. Amundi Luxembourg S.A. wurde am 01.07.2022 zur Verwaltungsgesellschaft des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) ernannt.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Kalenderjahrs 2022 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	97	8.867.445	1.732.476	10.599.921
Davon				
- Ermittelte Mitarbeiter	12	1.976.045	695.120	2.671.164
- Alle sonstigen Mitarbeiter	85	6.891.400	1.037.357	7.928.757

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 DER AUSLAGERUNGSUNTERNEHMEN

Vom 1. Juli 2022 bis 5. Dezember 2022: Amundi Deutschland GmbH war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter (147), betrug EUR 542.035 wovon EUR 311.838 auf die feste und EUR 230.198 auf die variable Vergütung entfielen. Die auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) entfallende anteilige Gesamtvergütung der Geschäftsführer (6) betrug EUR 55.233; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil der Gesamtvergütung der Führungskräfte (6) betrug EUR 19.301; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter mit Kontrollfunktion (3) betrug EUR 8.214; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor.

Vom 6. Dezember 2022 bis 30. Juni 2023: Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 22.233 EUR, davon 9.493 EUR in der festen Vergütung und 12.740 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 125.090 EUR, davon 83.215 EUR in der festen Vergütung und 41.875 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2022 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1.673 Mitarbeiter von denen 81 Mitarbeiter identified 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 14. November 2023

Amundi Luxembourg S.A



# Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF)

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>129.254.985,47</b>	<b>100,08</b>
1. Aktien		129.145.169,22	100,00
- Audiovisuelle Industrie	1.273.168,02		0,99
- Bau und Baustoffe	1.886.142,58		1,46
- Bergbau	6.274.379,80		4,86
- Büroausstattung	3.163.689,92		2,45
- Chemische Industrie	11.632.385,48		9,01
- Einzelhandel	4.424.820,54		3,43
- Elektrik / Elektronik	5.957.899,99		4,61
- Energieversorger	3.410.225,31		2,64
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	16.738.865,78		12,96
- Papier- und Verpackungsindustrie	3.359.410,40		2,60
- Pharmaindustrie / Biotech	16.359.574,60		12,67
- Real Estate	5.767.613,52		4,47
- Software	8.306.578,10		6,43
- Sonstige Dienstleistungen	1.332.765,00		1,03
- Sonstige industrielle Werte	4.921.833,36		3,81
- Telekommunikation	9.898.106,89		7,66
- Textilien und Kleidung	5.907.320,64		4,57
- Transportation	10.138.370,74		7,85
- Unterhaltungsindustrie	1.470.013,00		1,14
- Verbrauchsgüter	3.927.654,00		3,04
- Versicherungen	2.994.351,55		2,32
2. Forderungen		44.436,60	0,03
3. Bankguthaben		65.379,65	0,05
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-103.435,91</b>	<b>-0,08</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>129.151.549,56</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

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

# Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF)

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondersvermögens	
							im Berichtszeitraum			
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Aktien</b>										
<b>Inland</b>										
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE		STK	119.671	67.272	28.733	EUR 31,090	3.720.571,39	2,88	
DE0006766504	Aurubis AG		STK	32.093	18.303	8.028	EUR 78,540	2.520.584,22	1,95	
DE0005158703	Bechtle AG		STK	87.106	49.706	21.799	EUR 36,320	3.163.689,92	2,45	
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	38.881	22.725	10.268	EUR 99,040	3.850.774,24	2,98	
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	1.080.965	633.911	208.415	EUR 9,379	10.138.370,74	7,85	
DE0005565204	Dürr AG		STK	51.750	66.228	49.669	EUR 29,640	1.533.870,00	1,19	
DE0006095003	ENCAVIS AG		STK	128.437	71.163	29.665	EUR 15,025	1.929.765,93	1,49	
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	218.141	181.760	111.873	EUR 17,430	3.802.197,63	2,94	
DE0005664809	Evotec SE		STK	157.253	240.343	189.771	EUR 20,610	3.240.984,33	2,51	
DE0005773303	Fraport AG Ffm.Airport.Ser.AG		STK	38.603	21.517	9.290	EUR 48,860	1.886.142,58	1,46	
DE000A0Z2Z25	freenet AG		STK	126.498	79.670	39.108	EUR 22,980	2.906.924,04	2,25	
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	211.739	233.491	21.752	EUR 43,770	9.267.816,03	7,18	
DE0006602006	GEA Group AG		STK	155.118	122.670	76.445	EUR 38,310	5.942.570,58	4,60	
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG		STK	32.584	18.160	5.144	EUR 103,100	3.359.410,40	2,60	
DE000A13SX22	HELLA GmbH & Co. KGaA		STK	21.763	27.262	5.499	EUR 72,100	1.569.112,30	1,21	
DE000A161408	HelloFresh SE		STK	173.790	340.502	166.712	EUR 22,600	3.927.654,00	3,04	
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG		STK	61.851	35.037	15.206	EUR 71,540	4.424.820,54	3,43	
DE0006219934	Jungheinrich AG		STK	51.067	29.734	13.373	EUR 33,540	1.712.787,18	1,33	
DE000KSA8888	K+S Aktiengesellschaft		STK	203.630	211.150	145.911	EUR 15,955	3.248.916,65	2,52	
DE000KX8881	KION GROUP AG		STK	74.537	43.238	20.572	EUR 36,860	2.747.433,82	2,13	
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	70.332	43.910	21.377	EUR 69,980	4.921.833,36	3,81	
DE0006335003	KRONES AG		STK	16.080	16.080	0	EUR 111,100	1.786.488,00	1,38	
DE0005470405	LANXESS AG		STK	82.337	82.064	58.838	EUR 27,600	2.272.501,20	1,76	
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	78.845	57.447	31.269	EUR 52,640	4.150.400,80	3,21	
DE0006452907	Nemetschek SE		STK	66.785	39.092	12.752	EUR 68,640	4.584.122,40	3,55	
DE000A0D6554	Nordex SE		STK	133.075	143.980	10.905	EUR 11,125	1.480.459,38	1,15	
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE		STK	149.048	101.014	74.730	EUR 8,542	1.273.168,02	0,99	
DE0006969603	PUMA SE		STK	107.172	126.232	19.060	EUR 55,120	5.907.320,64	4,57	
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	79.090	47.512	21.824	EUR 58,080	4.593.547,20	3,56	
DE000A0DJ6J9	SMA Solar Technology AG		STK	19.994	19.994	0	EUR 111,900	2.237.328,60	1,73	
DE000A2GS401	Software AG		STK	50.268	77.746	64.349	EUR 31,860	1.601.538,48	1,24	
DE000STAB1L8	Stabilus SE		STK	26.278	32.592	6.314	EUR 55,050	1.446.603,90	1,12	
DE0007493991	Ströer SE & Co. KGaA		STK	33.034	19.234	11.369	EUR 44,500	1.470.013,00	1,14	
DE0008303504	TAG Immobilien AG		STK	186.702	138.789	58.013	EUR 8,662	1.617.212,72	1,25	
DE000TLX1005	Talanx AG		STK	56.981	35.851	17.411	EUR 52,550	2.994.351,55	2,32	
DE000A2YN900	TeamViewer AG		STK	144.182	82.979	45.458	EUR 14,710	2.120.917,22	1,64	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	930.398	604.964	321.510	EUR 2,577	2.397.635,65	1,86	
DE0007500001	thyssenkrupp AG		STK	523.688	761.453	593.675	EUR 7,168	3.753.795,58	2,91	
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG		STK	18.360	11.465	3.950	EUR 125,750	2.308.770,00	1,79	
								<b>EUR</b>	<b>127.812.404,22</b>	<b>98,96</b>
<b>Ausland</b>										
LU1704650164	BEFESA S.A.		STK	38.079	23.695	11.495	EUR 35,000	1.332.765,00	1,03	
								<b>EUR</b>	<b>1.332.765,00</b>	<b>1,03</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>										
								<b>EUR</b>	<b>129.145.169,22</b>	<b>100,00</b>
<b>Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>										
<b>EUR-Guthaben bei:</b>										
Verwahrstelle			EUR	65.070,39			% 100,000	65.070,39	0,05	
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
Verwahrstelle			USD	336,74			% 100,000	309,26	0,00	
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
Forderungen Aktien			EUR	43.702,75				<b>44.436,60</b>	<b>0,03</b>	
Quellensteuererstattungsansprüche			EUR	733,85				43.702,75	0,03	
								733,85	0,00	
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften			EUR	-5.441,79				<b>-103.435,91</b>	<b>-0,08</b>	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-97.994,12				-5.441,79	0,00	
								-97.994,12	-0,08	
<b>Wert des Teilsondersvermögens</b>								<b>EUR</b>	<b>129.151.549,56</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>								<b>EUR</b>	<b>143,32</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>								<b>STK</b>	<b>901.123</b>	

Fußnoten:

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

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

Die Vermögensgegenstände des Teilsondervermögens sind auf der Grundlage nachstehender Kurse/Marktsätze bewertet:  
 Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2023

**Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.06.2023**

US-Dollar (USD) 1,08885 = 1 EUR

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE0005419105	CANCOM SE	STK	1.112	27.531	
DE000CBK1001	Commerzbank AG	STK	434.785	1.199.039	
DE0005470306	CTS Eventim AG & Co. KGaA	STK	2.305	44.730	
DE000A2E4K43	Delivery Hero SE	STK	27.523	147.582	
DE000A0HN5C6	Deutsche Wohnen SE	STK	59.372	94.943	
DE000A3E5D64	Fuchs Petrolub SE	STK	2.728	52.980	
DE0007010803	RATIONAL AG	STK	1.597	5.284	
DE0007030009	Rheinmetall AG	STK	33.069	43.585	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG	STK	295.284	627.967	
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK	10.509	22.548	
DE0007231326	Sixt SE	STK	490	9.648	
DE000A31C3C0	TAG Immobilien AG - Anrechte	STK	106.364	106.364	
DE000UNSE018	Uniper SE	STK	5.174	63.493	
DE0005089031	United Internet AG	STK	53.603	117.020	
DE000A3H3LL2	Vantage Towers AG	STK	0	66.778	
DE000A0TGJ55	VARTA AG	STK	2.131	15.534	
DE000A0JL9W6	VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG	STK	23.420	23.420	
<b>Ausland</b>					
US00486H1059	ADTRAN Holdings Inc.	STK	53.130	53.130	
LU1673108939	Aroundtown SA	STK	506.257	1.219.931	
LU2489901806	Aroundtown SA - Anrechte	STK	0	713.674	
LU0775917882	Grand City Properties S.A.	STK	2.480	61.429	
LU2489676689	Grand City Properties S.A. - Anrechte	STK	0	58.949	
LU0061462528	RTL Group S.A.	STK	24.866	51.405	

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		2.529.952,71	2,808
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		272.301,84	0,302
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		2.598,03	0,003
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-298.094,08	-0,331
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-41.616,66	-0,046
6. Sonstige Erträge		2.131,30	0,002
<b>Summe der Erträge</b>		<b>2.467.273,14</b>	<b>2,738</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-370.087,41	-0,411
2. Sonstige Aufwendungen		-574,67	-0,001
davon: Bankgebühren	-574,67		-0,001
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-370.662,08</b>	<b>-0,411</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>2.096.611,06</b>	<b>2,327</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		9.351.600,73	10,378
2. Realisierte Verluste		-30.104.796,89	-33,408
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-20.753.196,16</b>	<b>-23,030</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-18.656.585,10</b>	<b>-20,704</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		4.790.740,78	5,316
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		19.561.305,41	21,708
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>24.352.046,19</b>	<b>27,024</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>5.695.461,09</b>	<b>6,320</b>

**Entwicklung des Teilsongervermögens**

	2022 / 2023
	EUR
<b>I. Wert des Teilsongervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>102.396.533,53</b>
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-1.723.224,00
2. Mittelzufluss (netto)	20.863.909,55
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	24.409.750,93
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-3.545.841,38
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	1.918.869,39
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	5.695.461,09
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	4.790.740,78
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	19.561.305,41
<b>II. Wert des Teilsongervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>129.151.549,56</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsongervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>2.315.886,11</b>	<b>2,570</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		18.312.755,64	20,322
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-18.656.585,10	-20,704
3. Zuführung aus dem Teilsongervermögen <sup>2)</sup>		2.659.715,57	2,952
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>0,00</b>	<b>11,381</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		0,00	11,381
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>2.315.886,11</b>	<b>2,570</b>
1. Endausschüttung		2.315.886,11	2,570

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

2) Die Zuführung aus dem Teilsongervermögen 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	Teilsongervermög am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2022/2023	129.151.549,56	143,32
2021/2022	102.396.533,53	135,48
2020/2021	227.873.639,99	180,69
2019/2020	107.645.218,05	139,02

# Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF)

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

### Sonstige Angaben

Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF)

#### International Security Identification Number (ISIN)

DE000ETF9074

#### Anteilwert

EUR

143,32

#### Umlaufende Anteile

STK

901.123

Anleger

Private Anleger

Aktueller Ausgabeaufschlag

%

5,00

Aktueller Rücknahmeabschlag

%

5,00

Mindeststückelung

Anteil

1,00

Verwaltungsvergütung p. a.

%

0,30

Ertragsverwendung

ausschüttend

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

**100,00**

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

**0,00**

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2023 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 30.06.2023 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 bezahlter CSDR Gebühren

EUR

1.993,76

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

Negative Einlagezinsen

EUR

496,84

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

**0,30**

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 Anteilklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwandsersatzungen, 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 vor Ertragsausgleich

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

EUR

346.381,48

Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft

%

68,88

Davon für die Verwahrstelle

%

17,92

Davon für Dritte

%

13,2

#### Transaktionskosten

EUR

13.415,68

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 verbundenen 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 Aufwandsersatzungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)

0,29%

Höhe der Annual Tracking Difference

0,26%

Der im Geschäftsjahr 2022/2023 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

### 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.

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

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

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

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

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

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

**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 \_\_\_\_\_ an nachhaltigen Investitionen **62,25 %**

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

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Amundi Group berücksichtigt im Rahmen ihrer investmentbezogenen Ausschlusspolitik als Teil der Grundsätze für nachhaltiges Investieren von Amundi Group bereits bestimmte



wichtigste nachteilige Auswirkungen (Principal Adverse Impacts). Diese Ausschlüsse, die zusätzlich zu den oben genannten Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschluss von kontroversen Waffen, Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact, Kohle und Tabak.

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

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

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

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

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



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

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

- Ausschluss: Amundi Group hat normative, tätigkeitsbasierte und Sektor basierte Ausschlussregeln definiert, die einige der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren abdecken, die in der Offenlegungsverordnung aufgeführt sind.

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

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



### **Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?**

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

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

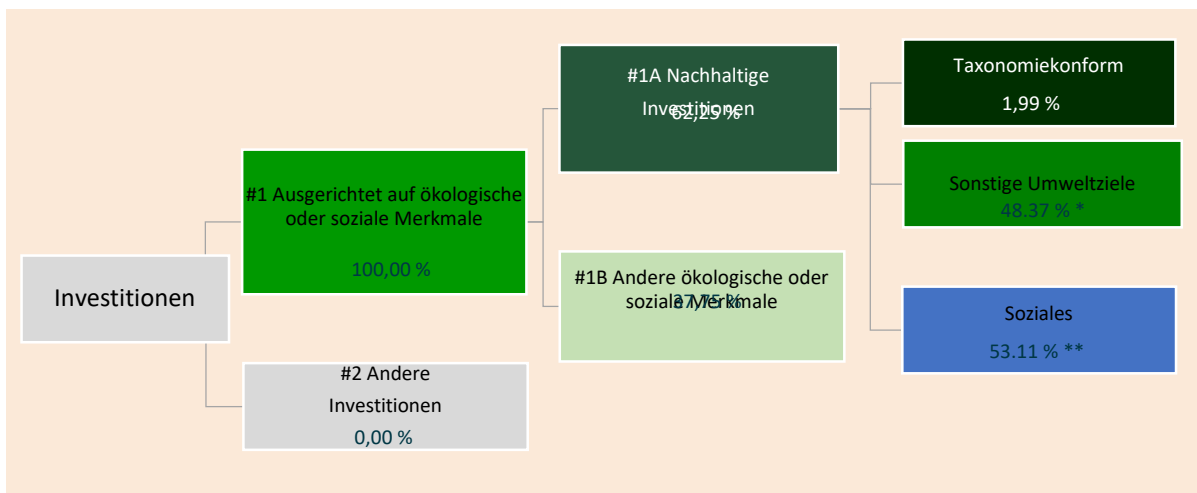
Die Daten in der obigen Tabelle basieren auf einem einzelnen Portfolio-Beobachtungspunkt zum Berichtszeitpunkt 30. Juni 2023.



### Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

#### Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



**#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.

*In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
<i>Industrie</i>	27,05 %
<i>Gesundheit</i>	15,27 %
<i>Grundstoffe</i>	13,86 %
<i>IT</i>	13,49 %
<i>Kommunikationsdienste</i>	9,79 %
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	9,21 %
<i>Immobilien</i>	4,47 %

Nicht-zyklische Konsumgüter	3,04 %
Finanzwesen	2,32 %
Öffentliche Dienstleistungen	1,49 %
Liquide Mittel	0,00 %

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 1,99 % in nachhaltige Investitionen investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen. Diese Investitionen trugen zu den Zielen der EU-Taxonomie im Hinblick auf die Verpflichtung zum Klimaschutz oder Klimaschutzmaßnahmen bei.

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

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

Ja:

In fossiles Gas

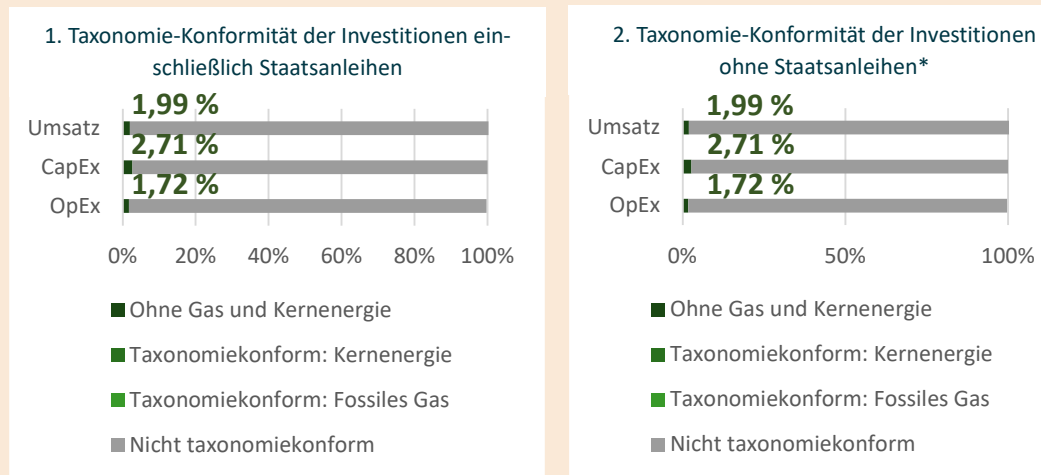
In Kernenergie

Nein

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

<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels (Klimaschutz<sup>2</sup>) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode 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 Ri Staaten

**Ermöglichende Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

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

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

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



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



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 **48,37 %**. \* Ein Teil dieser Investitionen trägt auch zu einem sozialen Ziel bei.

Der Anteil von **48,37 %** ist darauf zurückzuführen, dass einige Emittenten der im Teilsondervermögen gehaltenen Vermögensgegenstände zwar als nachhaltige Investitionen im Sinne der Offenlegungsverordnung gelten (können), aber ein Teil ihrer Aktivitäten nicht mit den EU-Taxonomiestandards in Einklang zu bringen ist oder für die noch keine Daten zur Verfügung stehen, um eine EU-Taxonomiebewertung durchzuführen.



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

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



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

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



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

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und gleichzeitig den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren. Durch verbindliche Elemente in der Indexmethodik wird sichergestellt, dass die ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu jedem Zeitpunkt der Neugewichtung erfüllt werden. Insbesondere verfolgt der MDAX ESG+ (NR) EUR die Performance des MDAX Index, wobei ESG-Ausschlussfilter und Bewertungsmethoden der Sustainalytics-ESG verwendet werden, um mindestens 20 Prozent der Unternehmen aus dem MDAX auszuschließen. Die Produktstrategie stützt sich auch auf eine gezielte Ausschlusspolitik (normativ und sektoriell), wie in den „Grundsätzen für nachhaltiges Investieren“ von Amundi Group näher beschrieben ist: <https://www.amundi.lu>



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

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

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen

wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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



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

**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 2022 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 2022 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 22. Juni 2022 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2022 fand am 01. Februar 2022 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 31.12.2022 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds. Amundi Luxembourg S.A. wurde am 01.07.2022 zur Verwaltungsgesellschaft des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) ernannt.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Kalenderjahrs 2022 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	97	8.867.445	1.732.476	10.599.921
Davon				
- Ermittelte Mitarbeiter	12	1.976.045	695.120	2.671.164
- Alle sonstigen Mitarbeiter	85	6.891.400	1.037.357	7.928.757

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 DER AUSLAGERUNGSUNTERNEHMEN**

Vom 1 July 2022 bis 5 Dezember 2022: Amundi Deutschland GmbH war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter (147), betrug EUR 542.035 wovon EUR 311.838 auf die feste und EUR 230.198 auf die variable Vergütung entfielen. Die auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1). entfallende anteilige Gesamtvergütung der Geschäftsführer (6) betrug EUR 55.233; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil der Gesamtvergütung der Führungskräfte (6) betrug EUR 19.301; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter mit Kontrollfunktion (3) betrug EUR 8.214; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor.

Vom 6 Dezember 2022 bis 30 Juni 2023: Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 22.233 EUR, davon 9.493 EUR in der festen Vergütung und 12.740 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1). entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 125.090 EUR, davon 83.215 EUR in der festen Vergütung und 41.875 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2022 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1.673 Mitarbeiter von denen 81 Mitarbeiter identified 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 14. November 2023

Amundi Luxembourg S.A

# Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF)

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>92.871.121,92</b>	<b>100,10</b>
1. Aktien		92.778.088,11	100,00
- Büroausstattung	6.439.023,85		6,94
- Elektrik / Elektronik	24.522.942,37		26,43
- Energieversorger	1.933.261,20		2,08
- Pharmaindustrie / Biotech	25.371.530,06		27,35
- Software	18.460.262,53		19,90
- Telekommunikation	16.051.068,10		17,30
2. Forderungen		4.409,25	0,00
3. Bankguthaben		88.624,56	0,10
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-93.977,04</b>	<b>-0,10</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>92.777.144,88</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

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

# Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF)

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge im Berichtszeitraum	Verkäufe/ Abgänge im Berichtszeitraum	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsonderversmögens
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Inland</b>									
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE		STK	104.120	17.411	6.054	EUR 31,090	3.237.090,80	3,49
DE0005104400	ATOSS Software AG		STK	3.678	3.678	0	EUR 207,500	763.185,00	0,82
DE0005158703	Bechtle AG		STK	75.789	12.572	4.469	EUR 36,320	2.752.656,48	2,97
DE0005419105	CANCOM SE		STK	35.957	8.667	2.917	EUR 27,740	997.447,18	1,08
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	33.818	5.583	1.977	EUR 99,040	3.349.334,72	3,61
DE000A288904	CompuGroup Medical SE & Co.KGaa		STK	23.446	3.818	1.348	EUR 45,080	1.056.945,68	1,14
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	493.088	74.028	32.184	EUR 19,976	9.849.925,89	10,62
DE0005659700	Eckert & Ziegler Str.-u.Med.AG		STK	13.155	13.486	331	EUR 36,380	478.578,90	0,52
DE0005664809	Evotec SE		STK	136.778	153.999	139.196	EUR 20,610	2.818.994,58	3,04
DE000A0Z2ZZ5	freenet AG		STK	110.067	24.228	12.418	EUR 22,980	2.529.339,66	2,73
DE000HAG0005	HENSOLDT AG		STK	48.369	7.922	2.781	EUR 30,080	1.454.939,52	1,57
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	253.737	25.381	115.681	EUR 37,785	9.587.452,55	10,33
DE000A2NB601	JENOPTIK AG		STK	47.133	7.729	2.710	EUR 31,440	1.481.861,52	1,60
DE0006632003	MorphoSys AG		STK	31.608	5.155	1.782	EUR 27,230	860.685,84	0,93
DE000A3H2200	Nagarro SE		STK	7.052	976	408	EUR 79,750	562.397,00	0,61
DE0006452907	Nemetschek SE		STK	58.103	15.039	3.179	EUR 68,640	3.988.189,92	4,30
DE000A0D6554	Nordex SE		STK	115.704	118.566	2.862	EUR 11,125	1.287.207,00	1,39
DE0007164600	SAP SE		STK	75.239	16.057	32.547	EUR 125,140	9.415.408,46	10,15
DE0007165631	Sartorius AG		STK	22.769	3.777	1.346	EUR 317,100	7.220.049,90	7,78
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	177.048	24.786	29.400	EUR 51,860	9.181.709,28	9,90
DE000WAF3001	Siltronic AG		STK	15.402	3.029	1.392	EUR 70,000	1.078.140,00	1,16
DE000A0DJ6J9	SMA Solar Technology AG		STK	17.384	2.846	999	EUR 111,900	1.945.269,60	2,10
DE000A2GS401	Software AG		STK	43.706	7.014	5.465	EUR 31,860	1.392.473,16	1,50
DE000A2YN900	TeamViewer AG		STK	125.361	17.017	13.608	EUR 14,710	1.844.060,31	1,99
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	808.948	159.479	90.223	EUR 2,577	2.084.659,00	2,25
DE0005089031	United Internet AG		STK	72.942	12.085	11.651	EUR 12,900	940.951,80	1,01
DE000A0JL9W6	VERBIO Vereinigt.BioEnergie AG		STK	17.532	2.409	1.132	EUR 36,850	646.054,20	0,70
							<b>EUR</b>	<b>82.805.007,95</b>	<b>89,26</b>
<b>Ausland</b>									
US00486H1059	ADTRAN Holdings Inc.		STK	66.949	68.513	1.564	EUR 9,652	646.191,75	0,70
AT0000A0E9W5	Kontron AG		STK	35.597	36.686	36.370	EUR 18,110	644.661,67	0,69
NL0012169213	Qiagen N.V.		STK	211.041	35.211	12.212	EUR 41,140	8.682.226,74	9,36
							<b>EUR</b>	<b>9.973.080,16</b>	<b>10,75</b>
							<b>EUR</b>	<b>92.778.088,11</b>	<b>100,01</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>									
<b>Bankguthaben, nicht verbrieft Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>									
							<b>EUR</b>	<b>88.624,56</b>	<b>0,10</b>
EUR-Guthaben bei:									
Verwahrstelle			EUR	80.388,40			% 100,000	80.388,40	0,09
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Verwahrstelle			USD	8.967,94			% 100,000	8.236,16	0,01
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Quellensteuererstattungsansprüche			EUR	4.409,25			<b>EUR</b>	<b>4.409,25</b>	<b>0,00</b>
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung			EUR	-93.977,04			<b>EUR</b>	<b>-93.977,04</b>	<b>-0,10</b>
<b>Wert des Teilsonderversmögens</b>									
<b>Anteilwert</b>							<b>EUR</b>	<b>92.777.144,88</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Umlaufende Anteile</b>							<b>EUR</b>	<b>24,22</b>	
							<b>STK</b>	<b>3.830.000</b>	

Fußnoten:

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

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2023

Keine Fremdwährungskurse

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE0005545503	1&1 AG	STK	374	31.676	
DE000A3H3LL2	Vantage Towers AG	STK	0	76.351	
DE000A0TGJ55	VARTA AG	STK	1.563	16.887	
<b>Ausland</b>					
LU2333210958	SUSE S.A.	STK	4.412	37.483	

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		1.490.381,00	0,389
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		50.991,66	0,013
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		1.138,66	0,000
4. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-113.177,92	-0,030
5. Abzug ausländischer Quellensteuer		-10.006,40	-0,003
6. Sonstige Erträge		481,18	0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>1.419.808,18</b>	<b>0,371</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-358.811,63	-0,094
2. Sonstige Aufwendungen davon: Bankgebühren	-91,06	-91,06	0,000
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-358.902,69</b>	<b>-0,094</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>1.060.905,49</b>	<b>0,277</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		2.570.556,81	0,671
2. Realisierte Verluste		-4.722.362,70	-1,233
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-2.151.805,89</b>	<b>-0,562</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>-1.090.900,40</b>	<b>-0,285</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		6.613.023,18	1,727
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		3.391.509,02	0,886
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>10.004.532,20</b>	<b>2,612</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>8.913.631,80</b>	<b>2,327</b>

**Entwicklung des Teilsongvermögens**

	2022 / 2023	
	EUR	EUR
<b>I. Wert des Teilsongvermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>83.457.957,79</b>
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-902.880,00
2. Mittelzufluss (netto)		1.307.359,46
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	3.284.033,77	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-1.976.674,31	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		1.075,83
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		8.913.631,80
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	6.613.023,18	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	3.391.509,02	
<b>II. Wert des Teilsongvermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>92.777.144,88</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsongvermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>17.285.338,27</b>	<b>4,513</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		18.376.238,67	4,798
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		-1.090.900,40	-0,285
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>15.676.738,27</b>	<b>4,093</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		1.760.166,54	0,460
2. Vortrag auf neue Rechnung		13.916.571,73	3,634
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>1.608.600,00</b>	<b>0,420</b>
1. Endausschüttung		1.608.600,00	0,420

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

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsongvermög am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2022/2023	92.777.144,88	24,22
2021/2022	83.457.957,79	22,18
2020/2021	95.674.210,48	27,69
2019/2020	81.729.503,55	23,21

# Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF)

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

### Sonstige Angaben

**Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF)**  
**International Security Identification Number (ISIN)**

		<b>DE000ETF9082</b>
<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>24,22</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>3.830.000</b>
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Mindeststückelung	Anteil	1,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,40
Ertragsverwendung		ausschüttend
<b>Bestand der Wertpapiere am Teilsongendvermögen (in %)</b>		<b>100,01</b>
<b>Bestand der Derivate am Teilsongendvermögen (in %)</b>		<b>0,00</b>

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2023 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 30.06.2023 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 483,62

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

EUR 89,53

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

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

**0,40**

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

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsongendvermögen eine im Besonderen Teil beschriebene Kostenpauschale (die „Pauschalgebühr“), die für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedlich sein kann. Einzelheiten zu den Vergütungen und Aufwandsersatzungen, mit denen das jeweilige Teilsongendvermögen 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 Teilsongendvermögen 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 vor Ertragsausgleich

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

	<b>EUR</b>	<b>360.497,26</b>
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	76,89
Davon für die Verwahrstelle	%	13,2
Davon für Dritte	%	9,91

#### Transaktionskosten

**EUR 1.224,38**

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 Teilsongendvermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsongendvermögens über Broker ausgeführt wurden, die eng verbundenen 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 Teilsongendvermögen an die Verwahrstelle und an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen.

Die EU-Verwaltungsgesellschaft zahlt keine Vergütung an Vermittler.

#### Angaben für Indexfonds

Höhe des Tracking Errors zum Ende des Berichtszeitraums (annualisiert)	0,07%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,64%

Der im Geschäftsjahr 2022/2023 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

#### 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.

### 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 2022 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 2022 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxemburg am 22. Juni 2022 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2022 fand am 01. Februar 2022 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 31.12.2022 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds. Amundi Luxembourg S.A. wurde am 01.07.2022 zur Verwaltungsgesellschaft des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) ernannt.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Kalenderjahrs 2022 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	97	8.867.445	1.732.476	10.599.921
Davon				
- Ermittelte Mitarbeiter	12	1.976.045	695.120	2.671.164
- Alle sonstigen Mitarbeiter	85	6.891.400	1.037.357	7.928.757

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 DER AUSLAGERUNGSUNTERNEHMEN

Vom 1 July 2022 bis 5 Dezember 2022: Amundi Deutschland GmbH war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter (147), betrug EUR 542.035 wovon EUR 311.838 auf die feste und EUR 230.198 auf die variable Vergütung entfielen. Die auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1). entfallende anteilige Gesamtvergütung der Geschäftsführer (6) betrug EUR 55.233; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil der Gesamtvergütung der Führungskräfte (6) betrug EUR 19.301; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter mit Kontrollfunktion (3) betrug EUR 8.214; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor.

Vom 6 Dezember 2022 bis 30 Juni 2023: Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 22.233 EUR, davon 9.493 EUR in der festen Vergütung und 12.740 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1). entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 125.090 EUR, davon 83.215 EUR in der festen Vergütung und 41.875 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2022 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1.673 Mitarbeiter von denen 81 Mitarbeiter identified 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 14. November 2023

Amundi Luxembourg S.A



# Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF

## (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF)

### Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>53.061.881,20</b>	<b>100,05</b>
1. Aktien		52.783.268,96	99,52
- Aeronautik und Weltraum	80.003,80		0,15
- Audiovisuelle Industrie	380.886,27		0,72
- Banken	5.772.388,29		10,88
- Bau und Baustoffe	2.395.427,34		4,52
- Bergbau	497.130,14		0,94
- Büroausstattung	359.805,17		0,68
- Chemische Industrie	1.761.009,97		3,32
- Einzelhandel	1.315.178,53		2,48
- Elektrik / Elektronik	3.939.270,79		7,43
- Energieversorger	4.037.159,22		7,61
- Freizeit/Tourismus	154.153,58		0,29
- Holdinggesellschaften	286.506,60		0,54
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	3.151.502,61		5,94
- Papier und andere Basisprodukte	205.933,01		0,39
- Papier- und Verpackungsindustrie	227.403,78		0,43
- Pharmaindustrie / Biotech	10.112.604,51		19,07
- Real Estate	571.013,96		1,08
- Software	1.171.072,63		2,21
- Sonstige Dienstleistungen	1.419.363,26		2,68
- Sonstige Finanzdienstleistungen	731.846,31		1,38
- Sonstige industrielle Werte	1.072.605,63		2,02
- Telekommunikation	1.765.615,95		3,33
- Textilien und Kleidung	2.368.391,67		4,47
- Transportation	862.912,19		1,63
- Unterhaltungsindustrie	283.630,25		0,53
- Verbrauchsgüter	4.804.704,34		9,06
- Versicherungen	3.055.749,16		5,76
2. Forderungen		251.066,54	0,47
3. Bankguthaben		27.545,70	0,05
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-24.977,08</b>	<b>-0,05</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>53.036.904,12</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

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

# Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF

(vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF)

Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondersvermögens
							im Berichtszeitraum		
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>									
<b>Aktien</b>									
<b>Inland</b>									
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	1.028	261	339	EUR 177,780	182.757,84	0,34
DE000A0WMPJ6	AIXTRON SE		STK	858	463	318	EUR 31,090	26.675,22	0,05
DE0008404005	Allianz SE		STK	2.523	589	662	EUR 213,200	537.903,60	1,01
DE0006766504	Aurubis AG		STK	188	17	340	EUR 78,540	14.765,52	0,03
DE000BASF111	BASF SE		STK	5.694	6.647	6.641	EUR 44,470	253.212,18	0,48
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	1.998	531	608	EUR 112,520	224.814,96	0,42
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	654	247	204	EUR 121,250	79.297,50	0,15
DE000A1DAH0	Brenntag SE		STK	876	286	349	EUR 71,400	62.546,40	0,12
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	195	96	88	EUR 99,040	19.312,80	0,04
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	6.196	2.557	2.949	EUR 10,150	62.889,40	0,12
DE0005439004	Continental AG		STK	748	349	258	EUR 69,100	51.686,80	0,10
DE0006062144	Covestro AG		STK	1.316	378	237	EUR 47,580	62.615,28	0,12
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG		STK	3.424	3.433	9	EUR 33,000	112.992,00	0,21
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	12.937	3.269	3.213	EUR 9,618	124.428,07	0,23
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	1.166	304	318	EUR 169,100	197.170,60	0,37
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG		STK	4.224	2.899	2.046	EUR 9,379	39.616,90	0,07
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	6.123	1.669	1.650	EUR 44,730	273.881,79	0,52
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	21.639	5.826	6.226	EUR 19,976	432.260,66	0,82
DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG		STK	731	731	0	EUR 113,750	83.151,25	0,16
DE0006095003	ENCAVIS AG		STK	593	593	0	EUR 15,025	8.909,83	0,02
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	1.221	0	0	EUR 17,430	21.282,03	0,04
DE0005664809	Evotec SE		STK	1.131	1.156	25	EUR 20,610	23.309,91	0,04
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	1.321	615	502	EUR 43,770	57.820,17	0,11
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA		STK	2.671	1.025	935	EUR 25,370	67.763,27	0,13
DE0006020006	GEA Group AG		STK	872	180	289	EUR 38,310	33.406,32	0,06
DE000A0LD6E6	Gerresheimer AG		STK	239	240	1	EUR 103,100	24.640,90	0,05
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	391	92	66	EUR 194,350	75.990,85	0,14
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	903	477	479	EUR 75,200	67.905,60	0,13
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	977	420	526	EUR 73,260	71.575,02	0,13
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG		STK	348	233	157	EUR 71,540	24.895,92	0,05
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	8.089	1.713	1.723	EUR 37,785	305.642,87	0,58
DE000KX8881	KION GROUP AG		STK	437	0	0	EUR 36,860	16.107,82	0,03
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	387	205	153	EUR 69,980	27.082,26	0,05
DE0005470405	LANXESS AG		STK	497	0	0	EUR 27,600	13.717,20	0,03
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	420	0	23	EUR 52,640	22.108,80	0,04
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG		STK	4.991	1.336	1.359	EUR 73,670	367.686,97	0,69
DE0006599905	Merck KGaA		STK	802	180	219	EUR 151,550	121.543,10	0,23
DE000A0D9PT0	MTU Aero Engines AG		STK	337	337	0	EUR 237,400	80.003,80	0,15
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	863	211	218	EUR 343,600	296.526,80	0,56
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	869	155	217	EUR 55,160	47.934,04	0,09
DE0006969603	PUMA SE		STK	724	390	231	EUR 55,120	39.906,88	0,08
DE0007164600	SAP SE		STK	6.770	1.919	2.064	EUR 125,140	847.197,80	1,60
DE0007165631	Sartorius AG		STK	168	49	31	EUR 317,100	53.272,80	0,10
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	398	67	149	EUR 58,080	23.115,84	0,04
DE0007236101	Siemens AG		STK	4.685	1.302	1.388	EUR 152,540	714.649,90	1,35
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	3.396	2.681	1.949	EUR 16,180	54.947,28	0,10
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	1.764	508	597	EUR 51,860	91.481,04	0,17
DE000SYM9999	Symrise AG		STK	779	148	203	EUR 96,020	74.799,58	0,14
DE000TLX1005	Talanx AG		STK	320	320	0	EUR 52,550	16.816,00	0,03
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	6.985	3.427	2.058	EUR 2,577	18.000,35	0,03
DE0007500001	thyssenkrupp AG		STK	2.918	0	0	EUR 7,168	20.916,22	0,04
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	1.273	382	292	EUR 122,940	156.502,62	0,30
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	4.069	674	1.086	EUR 17,895	72.814,76	0,14
DE000WCH8881	Wacker Chemie AG		STK	102	122	130	EUR 125,750	12.826,50	0,02
DE000ZAL1111	Zalando SE		STK	1.387	659	595	EUR 26,360	36.561,32	0,07
							<b>EUR</b>	<b>6.851.641,14</b>	<b>12,92</b>
<b>Ausland</b>									
GB00B1YW4409	3i Group PLC		STK	5.900	1.186	1.406	GBP 19,485	133.964,34	0,25
DK0010244508	A.P.Møller-Mærsk A/S		STK	30	8	14	DKK 11.975,00	48.247,71	0,09
IT0001233417	A2A S.p.A.		STK	9.525	0	0	EUR 1,673	15.935,33	0,03
SE0011337708	AAK AB		STK	1.083	804	507	SEK 202,800	18.637,79	0,04
NL0000852564	Aalberts N.V.		STK	504	123	244	EUR 38,530	19.419,12	0,04
NL0015001C01	Aalberts N.V. - Anrechte		STK	504	504	0	EUR 0,000	0,00	0,00
CH0012221716	ABB Ltd.		STK	9.966	2.817	2.713	CHF 35,180	359.206,88	0,68
NL0011540547	ABN AMRO Bank N.V.		STK	2.628	1.453	1.306	EUR 14,230	37.396,44	0,07
ES0125220311	Acciona S.A.		STK	140	32	42	EUR 155,400	21.756,00	0,04
FR0000120404	ACCOR S.A.		STK	1.106	0	0	EUR 34,020	37.626,12	0,07
BE0003764785	Ackermans & van Haaren N.V.		STK	167	351	184	EUR 150,800	25.183,60	0,05
ES0167050915	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA		STK	1.305	355	511	EUR 32,170	41.981,85	0,08
SE0014781795	Addtech AB		STK	1.524	1.005	1.108	SEK 234,800	30.365,55	0,06
CH0012138605	Adecco Group AG		STK	1.165	421	279	CHF 29,230	34.888,53	0,07
BE0003851681	Aedifica S.A.		STK	302	149	77	EUR 58,700	17.727,40	0,03
BE0970183860	Aedifica S.A. - Anrechte		STK	302	302	0	EUR 0,420	126,84	0,00
BE6344703309	Aedifica S.A. - Anrechte		STK	302	302	0	EUR 0,000	0,00	0,00
NL0000303709	AEGON N.V.		STK	9.690	4.675	6.023	EUR 4,630	44.864,70	0,08
ES0105046009	Aena SME S.A.		STK	431	37	53	EUR 148,000	63.788,00	0,12
FR0010340141	Aéroports de Paris S.A.		STK	170	0	0	EUR 131,500	22.355,00	0,04
BE0974264930	AGEAS SA/NV		STK	1.008	346	337	EUR 37,110	37.406,88	0,07
NL0011794037	Ahold Delhaize N.V., Konkinkl.		STK	6.209	1.544	1.834	EUR 31,260	194.093,34	0,37
IE00BFL03536	AIB Group PLC		STK	6.735	6.735	0	EUR 3,850	25.929,75	0,05
FR0000031122	Air France-KLM S.A.		STK	11.264	11.264	0	EUR 1,723	19.407,87	0,04
FR0000120073	Air Liquide-SA Ét.Expl.P.G.Cl.		STK	3.276	3.335	59	EUR 164,200	537.919,20	1,01

NO0010345853	Aker BP ASA	STK	1.874	1.454	371	NOK	251,800	40.370,72	0,08
NL0013267909	Akzo Nobel N.V.	STK	1.030	289	398	EUR	74,720	76.961,60	0,15
CH0432492467	Alcon AG	STK	3.190	829	717	CHF	74,100	242.179,19	0,46
SE0000695876	Alfa Laval AB	STK	1.823	411	396	SEK	393,000	60.796,32	0,11
DK0061802139	ALK-Abelló AS	STK	755	614	424	DKK	74,450	7.549,04	0,01
LU2237380790	Allegro.eu	STK	2.511	2.511	0	PLN	32,000	18.127,31	0,03
FR0010220475	Alstom S.A.	STK	1.816	393	453	EUR	27,320	49.613,12	0,09
FR0000071946	Alten S.A.	STK	178	0	0	EUR	144,300	25.685,40	0,05
ES0109067019	Amadeus IT Group S.A.	STK	2.818	628	582	EUR	69,700	196.414,60	0,37
DK0060946788	Ambu A/S	STK	983	1.116	1.215	DKK	111,650	14.739,82	0,03
AT0000A18XM4	ams AG	STK	2.525	1.661	371	CHF	6,442	16.665,18	0,03
FR0004125920	Amundi S.A.	STK	323	37	91	EUR	54,050	17.458,15	0,03
AT0000730007	Andritz AG	STK	425	440	463	EUR	51,050	21.696,25	0,04
GB00B1XZS820	Anglo American PLC	STK	7.782	3.100	3.852	GBP	22,330	202.496,14	0,38
BE0974293251	Anheuser-Busch InBev S.A./N.V.	STK	5.601	1.529	1.607	EUR	51,830	290.299,83	0,55
GB0000456144	Antofagasta PLC	STK	2.361	2.963	4.694	GBP	14,610	40.196,01	0,08
NL00006237562	Arcadis N.V.	STK	451	0	0	EUR	38,280	17.264,28	0,03
LU1598757687	ArcelorMittal S.A.	STK	3.416	1.203	2.350	EUR	24,930	85.160,88	0,16
FR0010313833	Arkema S.A.	STK	333	68	136	EUR	86,300	28.737,90	0,05
NL0000334118	ASM International N.V.	STK	281	73	86	EUR	388,350	109.126,35	0,21
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	2.516	635	687	EUR	663,000	1.668.108,00	3,15
NL0011872643	ASR Nederland N.V.	STK	876	596	559	EUR	41,240	36.126,24	0,07
SE0007100581	Assa-Abloy AB	STK	6.261	1.535	1.443	SEK	259,000	137.607,31	0,26
IT0000062072	Assicurazioni Generali S.p.a.	STK	6.915	1.579	1.381	EUR	18,620	128.757,30	0,24
GB0009895292	AstraZeneca PLC	STK	9.695	2.516	2.612	GBP	112,760	1.273.912,72	2,40
SE0017486889	Atlas Copco AB	STK	15.939	3.671	3.744	SEK	155,400	210.189,07	0,40
GB00BPQY8M80	Aviva PLC	STK	16.448	1.518	3.646	GBP	3,952	75.747,25	0,14
FR0000120628	AXA S.A.	STK	12.129	2.988	3.470	EUR	27,025	327.786,23	0,62
SE0006993770	Axfood AB	STK	633	191	238	SEK	228,200	12.257,94	0,02
BE0974400328	Azelis Group N.V.	STK	897	897	0	EUR	20,880	18.729,36	0,04
IT0003261697	Azimut Holding S.p.A.	STK	922	922	0	EUR	19,755	18.214,11	0,03
FO0000000179	Bakkafrost P/F	STK	370	421	282	NOK	642,000	20.322,54	0,04
GB0000961622	Balfour Beatty PLC	STK	3.516	5.707	2.191	GBP	3,408	13.963,21	0,03
CH0012410517	Baloise Holding AG	STK	268	141	129	CHF	131,400	36.079,30	0,07
ES0113211835	Banco Bilbao Vizcaya Argent.	STK	37.719	9.274	10.445	EUR	7,032	265.240,01	0,50
IT0005218380	Banco BPM S.p.a.	STK	8.854	8.854	0	EUR	4,250	37.629,50	0,07
ES0113860A34	Banco de Sabadell S.A.	STK	34.215	0	0	EUR	1,054	36.062,61	0,07
ES0113900J37	Banco Santander S.A.	STK	102.497	27.065	33.807	EUR	3,385	346.952,35	0,65
IE00BD1RP616	Bank of Ireland Group PLC	STK	6.254	880	539	EUR	8,738	54.647,45	0,10
ES0113679137	Bankinter S.A.	STK	3.908	0	0	EUR	5,630	22.002,04	0,04
GB0031348658	Barclays PLC	STK	90.298	19.343	30.671	GBP	1,534	161.392,61	0,30
GB0000811801	Barratt Developments PLC	STK	6.173	0	962	GBP	4,135	29.744,64	0,06
CH0009002962	Barry Callebaut AG	STK	21	6	5	CHF	1.727,000	37.156,91	0,07
NL0012866412	BE Semiconductor Inds N.V.	STK	534	209	136	EUR	99,300	53.026,20	0,10
GB00BYQ0JC66	Beazley PLC	STK	3.800	1.185	1.213	GBP	5,890	26.081,69	0,05
CH1101098163	BELIMO Holding AG	STK	65	42	37	CHF	446,200	29.714,67	0,06
GB0000904986	Bellway PLC	STK	815	65	0	GBP	19,880	18.880,38	0,04
GB00BLJNL82	Berkeley Group Holdings PLC	STK	668	59	74	GBP	39,230	30.537,37	0,06
GB0002869419	Big Yellow Group PLC	STK	1.316	533	647	GBP	10,730	16.454,99	0,03
SE0000862997	BillerudKorsnäs AB	STK	1.823	1.091	1.157	SEK	81,960	12.679,05	0,02
FR0013280286	bioMerieux	STK	296	0	0	EUR	96,120	28.451,52	0,05
FR0000131104	BNP Paribas S.A.	STK	7.326	2.132	2.050	EUR	57,720	422.856,72	0,80
SE0020050417	Boliden AB	STK	1.637	1.637	0	SEK	311,550	43.278,73	0,08
FR0000039299	Bolloré S.A.	STK	5.463	0	0	EUR	5,710	31.193,73	0,06
FR0000120503	Bouygues S.A.	STK	1.611	207	403	EUR	30,760	49.554,36	0,09
GB0007980591	BP PLC	STK	109.803	27.302	40.307	GBP	4,584	586.473,29	1,11
IT0000066123	BPER Banca S.p.a.	STK	6.268	8.075	1.807	EUR	2,782	17.437,58	0,03
GB0001367019	British Land Co. PLC, The	STK	6.072	1.356	1.423	GBP	3,028	21.425,18	0,04
GB00B0N8QD54	Britvic PLC	STK	1.866	905	665	GBP	8,560	18.613,25	0,04
GB0030913577	BT Group PLC	STK	43.643	13.652	16.178	GBP	1,224	62.223,63	0,12
GB00B0744B38	Bunzl PLC	STK	2.117	464	600	GBP	29,990	73.983,37	0,14
GB0031743007	Burberry Group PLC	STK	2.298	0	452	GBP	21,200	56.770,49	0,11
FR00006174348	Bureau Veritas SA	STK	1.703	309	382	EUR	25,120	42.779,36	0,08
ES0140609019	Caixabank S.A.	STK	24.183	5.123	7.774	EUR	3,787	91.581,02	0,17
FR0000125338	Capgemini SE	STK	1.087	295	270	EUR	173,550	188.648,85	0,36
FR0000120172	Carefour S.A.	STK	3.388	701	1.031	EUR	17,355	58.798,74	0,11
SE0000379190	Castellum AB	STK	3.159	2.586	1.266	SEK	102,950	27.597,77	0,05
ES0105066007	Cellex Telecom S.A.	STK	3.101	676	899	EUR	66,990	114.705,99	0,22
CH0225173167	Cembra Money Bank AG	STK	243	306	63	CHF	74,200	18.473,03	0,03
GB00B033F229	Centrica PLC	STK	34.334	2.904	9.971	GBP	1,240	49.591,55	0,09
CH0010570767	Chocoladef. Lindt & Sprüngli	STK	6	6	0	CHF	11.240,00	69.094,82	0,13
DK0060227585	Christian Hansen Holding AS	STK	622	34	122	DKK	473,600	39.562,34	0,07
FR001400AJ45	Cie Génie Étis Michelin SCpA	STK	4.456	1.277	1.303	EUR	27,060	120.579,36	0,23
CH0012142631	Clariant AG	STK	1.431	847	784	CHF	12,920	18.942,19	0,04
NL0010545661	CNH Industrial N.V.	STK	6.240	1.146	1.192	EUR	13,205	82.399,20	0,16
CH0198251305	Coca-Cola HBC AG	STK	1.247	753	731	GBP	23,450	34.075,80	0,06
BE0003593044	Cofinimmo S.A.	STK	165	9	25	EUR	68,800	11.352,00	0,02
DK0060448595	Coloplast AS	STK	747	187	187	DKK	853,200	85.595,58	0,16
FR0000125007	Compagnie de Saint-Gobain S.A.	STK	3.236	674	676	EUR	55,730	180.342,28	0,34
GB00BD6K4575	Compass Group PLC	STK	11.168	3.094	3.411	GBP	22,020	286.569,20	0,54
GB00BV9FP302	Computacenter PLC	STK	379	883	504	GBP	22,900	10.113,73	0,02
GB00BD3VFW73	ConvaTec Group PLC	STK	9.492	1.020	3.657	GBP	2,052	22.697,17	0,04
ES0105563003	Corporacion Acciona Energias R	STK	482	482	0	EUR	30,620	14.758,84	0,03
FR0000064578	Covivio S.A.	STK	309	23	0	EUR	43,180	13.342,62	0,03
FR0000045072	Crédit Agricole S.A.	STK	7.696	2.440	3.287	EUR	10,872	83.670,91	0,16
IE0001827041	CRH PLC	STK	4.705	1.022	1.339	EUR	50,500	237.602,50	0,45
GB00BJFFLV09	Croda International PLC	STK	894	218	283	GBP	56,260	58.610,31	0,11
FR0000120644	Danone S.A.	STK	4.011	1.096	1.095	EUR	56,140	225.177,54	0,42
DK0010274414	Danske Bank AS	STK	4.255	712	712	DKK	166,000	94.860,96	0,18
FR0014003TT8	Dassault Systemes SE	STK	4.506	1.405	1.465	EUR	40,625	183.056,25	0,35
NL0015435975	Davide Campari-Milano N.V.	STK	2.971	559	846	EUR	12,690	37.701,99	0,07
IE0002424939	DCC PLC	STK	673	143	162	GBP	43,980	34.491,10	0,07
GB0009633180	Dechra Pharmaceuticals PLC	STK	684	117	237	GBP	36,860	29.379,76	0,06
DK0060738599	Demant AS	STK	587	0	149	DKK	288,500	22.743,84	0,04
GB0002652740	Derwent London PLC	STK	690	251	344	GBP	20,500	16.483,13	0,03
GB0002374006	Diageo PLC	STK	14.066	3.719	4.170	GBP	33,790	553.854,38	1,04
BE0974259880	D'leteren Group S.A.	STK	167	191	171	EUR	161,900	27.037,30	0,05
CH0126673539	DKSH Holding AG	STK	210	123	138	CHF	66,550	14.318,43	0,03

NO0010161896	DNB Bank ASA	STK	5.732	1.920	1.782	NOK	200,700	98.422,59	0,19
GB0008220112	DS Smith PLC	STK	8.481	435	1.781	GBP	2.718	26.861,69	0,05
CH1216478797	DSM-Firmenich AG	STK	1.197	1.198	1	EUR	98,620	118.048,14	0,22
DK0060079531	DSV Panalpina A/S	STK	1.127	286	402	DKK	1.433,000	216.895,22	0,41
FR00101098533	Edenred S.A.	STK	1.545	433	406	EUR	61,340	94.770,30	0,18
ES0127797019	EDP Renováveis S.A.	STK	1.721	894	634	EUR	18,295	31.485,70	0,06
FR0000130452	Eiffage S.A.	STK	612	190	182	EUR	95,580	58.494,96	0,11
SE0016589188	Electrolux, AB	STK	1.831	1.155	371	SEK	147,200	22.871,48	0,04
SE0000163628	Elekta AB	STK	2.889	1.876	572	SEK	83,340	20.431,45	0,04
BE0003822393	Elia Group	STK	252	144	74	EUR	116,300	29.307,60	0,06
FR0012435121	Elis S.A.	STK	1.170	28	0	EUR	17,800	20.826,00	0,04
FI0009007884	Elisa Oyj	STK	993	390	248	EUR	48,940	48.597,42	0,09
ES0130960018	Enagas S.A.	STK	1.434	0	0	EUR	18,000	25.812,00	0,05
GB00BG12Y042	Energear PLC	STK	1.061	1.130	69	GBP	10,240	12.660,54	0,02
FR0010208488	Engie S.A.	STK	11.499	2.689	2.646	EUR	15,228	175.106,77	0,33
IT0003132476	ENI S.p.A.	STK	14.275	3.340	4.664	EUR	13,182	188.173,05	0,35
IM00B5VQMV65	Entain PLC	STK	3.871	1.496	1.495	GBP	12,720	57.378,22	0,11
SE0015658109	Epiroc AB	STK	3.934	843	875	SEK	203,900	68.069,04	0,13
SE0012853455	EQT AB	STK	5.001	1.880	1.087	SEK	207,400	88.016,41	0,17
NO0010096985	Equinor ASA	STK	6.555	1.616	1.930	NOK	312,100	175.028,06	0,33
AT0000652011	Erste Group Bank AG	STK	2.140	920	693	EUR	32,090	68.672,60	0,13
FR0000121667	EssilorLuxottica S.A.	STK	1.875	429	474	EUR	172,600	323.625,00	0,61
SE000922164	Essity AB	STK	3.611	882	1.074	SEK	287,100	87.974,89	0,17
FR0000121121	Eurazeo SE	STK	257	30	88	EUR	64,450	16.563,65	0,03
FR0014000MR3	Eurofins Scientific S.E.	STK	772	144	169	EUR	58,160	44.899,52	0,08
NL0006294274	Euronext N.V.	STK	593	176	69	EUR	62,300	36.943,90	0,07
GB00B19NLV48	Experian PLC	STK	5.749	1.698	1.910	GBP	30,180	202.184,72	0,38
SE0011166974	Fabeg AB	STK	1.085	576	921	SEK	77,560	7.141,11	0,01
SE0017832488	Fastighets AB Balder	STK	2.851	0	1.175	SEK	39,360	9.522,49	0,02
FR0000121147	Faurecia SE	STK	1.030	0	0	EUR	21,570	22.217,10	0,04
NL0011585146	Ferrari N.V.	STK	739	247	256	EUR	299,500	221.330,50	0,42
NL0015001FS8	Ferrovial SE	STK	3.249	6.789	3.540	EUR	28,970	94.123,53	0,18
IT0000072170	Finacobank Banca Fineco S.p.A.	STK	3.811	1.359	1.257	EUR	12,315	46.932,47	0,09
CY0200352116	Frontline PLC	STK	857	857	0	NOK	154,480	11.326,46	0,02
PTGAL0AM0009	Galp Energia SGPS S.A.	STK	3.334	2.402	2.245	EUR	10,720	35.740,48	0,07
FR0011726835	Gaztransport Technigaz	STK	185	115	72	EUR	93,250	17.251,25	0,03
CH0030170408	Geberit AG	STK	230	56	47	CHF	468,100	110.304,80	0,21
FR0010040865	Gecina S.A.	STK	288	0	0	EUR	97,550	28.094,40	0,05
CH1169151003	Georg Fischer AG	STK	480	316	336	CHF	67,150	33.022,90	0,06
SE0000202624	Getinge AB	STK	1.310	640	654	SEK	188,950	21.004,69	0,04
FR0010533075	Getlink SE	STK	2.027	543	1.172	EUR	15,580	31.580,66	0,06
CH0010645932	Givaudan SA	STK	48	11	12	CHF	2.695,00	145.812,20	0,27
NO0010582521	Gjensidige Forsikring ASA	STK	1.210	62	0	NOK	171,800	17.784,83	0,03
IE0000669501	Glanbia PLC	STK	1.150	1.150	1.210	EUR	13,700	15.755,00	0,03
DK0010272632	GN Store Nord AS	STK	668	853	983	DKK	170,200	15.269,19	0,03
IE00B00MZ448	Grafton Group PLC	STK	1.470	1.169	1.039	GBP	7,817	13.390,42	0,03
GB00B63QSB39	Greggs PLC	STK	619	0	0	GBP	25,540	18.422,49	0,03
ES0171996087	Grifols S.A.	STK	1.785	0	0	EUR	11,740	20.955,90	0,04
BE0003797140	Grpe Bruxelles Lambert SA(GBL)	STK	555	358	403	EUR	72,160	40.048,80	0,08
GB00BN7SWP63	GSK PLC	STK	25.616	32.177	6.561	GBP	13,888	414.560,40	0,78
SE0000106270	H & M Hennes & Mauritz AB	STK	4.397	1.246	1.490	SEK	185,180	69.095,31	0,13
GB0004052071	Halma PLC	STK	2.274	2.490	2.709	GBP	22,770	60.337,91	0,11
GB00BMBVGQ36	Harbour Energy PLC	STK	3.636	3.636	0	GBP	2,286	9.685,84	0,02
GB0004161021	Hays PLC	STK	10.025	11.956	12.455	GBP	1,022	11.939,11	0,02
NL0000008977	Heineken Holding N.V.	STK	769	403	249	EUR	79,650	61.250,85	0,12
NL0000009165	Heineken N.V.	STK	1.634	497	414	EUR	94,180	153.890,12	0,29
CH0466642201	Helvetia Holding AG	STK	209	210	176	CHF	121,000	25.909,53	0,05
IT0001250932	Hera S.p.A.	STK	4.900	0	0	EUR	2,722	13.337,80	0,03
FR0000052292	Hermes International S.C.A.	STK	220	53	58	EUR	1.990,000	437.800,00	0,83
SE0015961909	Hexagon AB	STK	12.430	2.350	3.163	SEK	132,750	140.024,40	0,26
GB00B0LCW083	Hikma Pharmaceuticals PLC	STK	978	131	420	GBP	18,905	21.545,29	0,04
CH0012214059	Holcim Ltd.	STK	3.403	804	879	CHF	60,200	209.887,40	0,40
SE0011090018	Holmen AB	STK	523	306	1.047	SEK	387,400	17.193,30	0,03
GB0005405286	HSBC Holdings PLC	STK	126.811	33.410	35.634	GBP	6,217	918.701,85	1,73
FI0009000459	Huhtamäki Oyj	STK	468	195	194	EUR	30,060	14.068,08	0,03
SE0001662230	Husqvarna AB	STK	2.442	1.744	1.278	SEK	97,640	20.233,52	0,04
ES0144580Y14	Iberdrola S.A.	STK	36.863	9.772	10.402	EUR	11,950	440.512,85	0,83
NL0010801007	IMCD N.V.	STK	324	35	58	EUR	131,700	42.670,80	0,08
GB00BGLP8L22	IMI PLC	STK	1.629	586	542	GBP	16,400	31.131,62	0,06
ES0148396007	Industria de Diseño Textil SA	STK	6.952	1.692	1.957	EUR	35,460	246.517,92	0,46
SE0001515552	Indutrade AB	STK	1.625	0	0	SEK	242,900	33.494,92	0,06
GB00BMJ6DW54	Infoma PLC	STK	8.351	559	2.137	GBP	7,260	70.649,96	0,13
IT0005090300	Infrastrutt. Wireless Italiane	STK	2.139	0	0	EUR	12,080	25.839,12	0,05
NL0011821202	ING Groep N.V.	STK	22.587	461	2.096	EUR	12,338	278.678,41	0,53
ES0139140174	Inmobiliaria Colonial SOCIMI	STK	1.818	0	0	EUR	5,545	10.080,81	0,02
GB00BHJYC057	InterContinental Hotels Group	STK	1.090	173	311	GBP	54,340	69.021,27	0,13
GB00BYT1DJ19	Intermediate Capital Grp PLC	STK	2.019	875	801	GBP	13,775	32.408,94	0,06
ES0177542018	Internat. Cons. Airl. Group SA	STK	14.917	9.472	9.670	GBP	1,619	28.142,66	0,05
IT0001078911	Interpump Group S.p.A.	STK	502	0	0	EUR	50,880	25.541,76	0,05
GB0031638363	Intertek Group PLC	STK	1.027	181	225	GBP	42,650	51.041,83	0,10
IT0000072618	Intesa Sanpaolo S.p.A.	STK	102.557	20.049	29.870	EUR	2,400	246.136,80	0,46
GB00B17BBQ50	Investec PLC	STK	4.160	907	1.446	GBP	4,408	21.368,39	0,04
SE0015811963	Investor AB	STK	11.653	3.146	2.799	SEK	215,650	213.248,14	0,40
FR0010259150	Ipsen S.A.	STK	217	54	65	EUR	110,200	23.913,40	0,05
DK0060542181	ISS AS	STK	821	685	767	DKK	144,250	15.905,19	0,03
IT0005211237	Italgas S.P.A.	STK	2.781	1.045	1.242	EUR	5,425	15.086,93	0,03
GB0033986497	ITV PLC	STK	24.021	0	4.479	GBP	0,683	19.118,27	0,04
GB00BM8Q5M07	JD Sports Fashion PLC	STK	16.320	4.460	3.229	GBP	1,460	27.765,78	0,05
NL0014332678	JDE Peet's N.V.	STK	682	682	0	EUR	27,260	18.591,32	0,04
PTJMT0AE0001	Jerónimo Martins, SGPS, S.A.	STK	1.894	1.200	984	EUR	25,240	47.804,56	0,09
GB00BZ4BQC70	Johnson, Matthey PLC	STK	1.308	417	470	GBP	17,460	26.612,69	0,05
CH0102484968	Julius Baer Gruppe AG	STK	1.425	1.785	1.749	CHF	56,340	82.254,50	0,16
DK0010307958	Jyske Bank A/S	STK	265	265	0	DKK	518,400	18.449,76	0,03
BE0003565737	KBC Groep N.V.	STK	1.571	482	546	EUR	63,920	100.418,32	0,19
FR0000121485	Kering S.A.	STK	450	104	119	EUR	505,600	227.520,00	0,43
IE0004906560	Kerry Group PLC	STK	994	232	202	EUR	89,380	88.843,72	0,17
FI0009000202	Kesko Oyj	STK	1.596	688	582	EUR	17,250	27.531,00	0,05
SE0007871645	Kindred Group PLC	STK	1.376	659	166	SEK	114,850	13.410,58	0,03



GB0033195214	Kingfisher PLC	STK	11.549	2.521	3.671	GBP	2,317	31.182,23	0,06
IE0004927939	Kingspan Group PLC	STK	934	95	129	EUR	60,900	56.880,60	0,11
SE0015810247	Kinnevik AB	STK	1.448	554	620	SEK	149,400	18.357,66	0,03
FR0000121964	Klépierre S.A.	STK	962	176	483	EUR	22,720	21.856,64	0,04
FI4000312251	Kojamo Oyj	STK	931	564	548	EUR	8,620	8.025,22	0,02
NL0000009082	Kon. KPN N.V.	STK	21.293	5.403	4.936	EUR	3,269	69.606,82	0,13
FI0009013403	KONE Oyj	STK	2.547	652	628	EUR	47,830	121.823,01	0,23
NL0000009538	Koninklijke Philips N.V.	STK	5.866	1.835	1.472	EUR	19,808	116.193,73	0,22
CH0025238863	Kühne & Nagel Internat. AG	STK	341	77	91	CHF	264,700	92.477,54	0,17
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX	STK	693	0	0	EUR	36,040	24.975,72	0,05
GB00BYW0PQ60	Land Securities Group PLC	STK	4.736	1.155	1.182	GBP	5,742	31.689,23	0,06
GB0005603997	Legal & General Group PLC	STK	36.689	8.359	10.308	GBP	2,273	97.178,93	0,18
FR0010307819	Legrand S.A.	STK	1.669	423	402	EUR	90,800	151.545,20	0,29
GB0008706128	Lloyds Banking Group PLC	STK	402.671	78.165	119.950	GBP	0,436	204.538,01	0,39
CH0025751329	Logitech International S.A.	STK	1.053	470	470	CHF	53,240	57.437,34	0,11
GB00B0SWJX34	London Stock Exchange Group PLC	STK	2.623	933	568	GBP	83,660	255.713,08	0,48
GB00B4WFW713	Londonmetric Property PLC	STK	7.730	2.397	1.975	GBP	1,654	14.898,82	0,03
CH0013841017	Lonza Group AG	STK	465	132	126	CHF	533,400	254.117,10	0,48
PLLP00000011	LPP S.A.	STK	7	0	0	PLN	14,010,00	22.124,46	0,04
FR0000121014	LVMH Moët Henn. L. Vuitton SE	STK	1.624	404	440	EUR	863,000	1.401.512,00	2,64
GB00BKFB1C65	M&G PLC	STK	14.864	0	3.067	GBP	1,914	33.152,36	0,06
JE000BJ1DLW90	Man Group Ltd.	STK	8.749	4.022	3.784	GBP	2,185	22.276,49	0,04
GB0031274896	Marks & Spencer Group PLC	STK	11.908	0	0	GBP	1,927	26.739,75	0,05
IT0000062957	Mediobanca - Bca Cred.Fin. SpA	STK	3.161	1.694	2.257	EUR	10,960	34.644,56	0,07
ES0105025003	Merlin Properties SOCIMI S.A.	STK	2.041	0	0	EUR	7,840	16.001,44	0,03
FI0009014575	Metso Outotec Oyj	STK	3.637	1.516	2.015	EUR	11,045	40.170,67	0,08
SE0001174970	Millicom Intl Cellular S.A.	STK	830	654	907	SEK	164,850	11.610,88	0,02
IT0004965148	Moncler S.p.A.	STK	1.339	473	467	EUR	63,340	84.812,26	0,16
GB00B1CRLC47	Mondi PLC	STK	2.675	910	1.333	GBP	11,990	37.374,88	0,07
NO0003054108	Mowi ASA	STK	2.674	713	802	NOK	170,200	38.936,97	0,07
GB00BDR05C01	National Grid PLC	STK	23.007	6.434	6.546	GBP	10,405	278.958,04	0,53
ES0116870314	Naturgy Energy Group S.A.	STK	966	0	222	EUR	27,260	26.333,16	0,05
GB00BM8PJY71	NatWest Group PLC	STK	32.242	42.614	10.372	GBP	2,408	90.472,23	0,17
FI0009013296	Neste Oyj	STK	2.746	873	776	EUR	35,260	96.823,96	0,18
CH0038863350	Nestlé S.A.	STK	16.661	3.953	5.051	CHF	107,600	1.836.712,87	3,46
FR0000044448	Nexans S.A.	STK	185	70	0	EUR	79,350	14.679,75	0,03
IT0005366767	Nexi S.p.A.	STK	3.791	724	1.198	EUR	7,182	27.226,96	0,05
SE0015988019	NIBE Industrier AB	STK	9.209	2.054	1.980	SEK	102,400	80.022,20	0,15
DK0010287663	NKT A/S	STK	433	433	0	DKK	413,800	24.063,47	0,05
GB00B7FC0762	NMC HEALTH PLC	STK	261	0	0	GBP	0,000	0,00	0,00
NL0010773842	NN Group N.V.	STK	1.549	685	872	EUR	33,910	52.526,59	0,10
FI0009000681	Nokia Oyj	STK	33.047	9.250	9.770	EUR	3,836	126.751,77	0,24
FI4000297767	Nordea Bank Abp	STK	22.202	6.612	8.253	EUR	9,966	221.265,13	0,42
NO0003055501	Nordic Semiconductor ASA	STK	740	497	854	NOK	130,450	8.258,80	0,02
NO0005052605	Norsk Hydro ASA	STK	8.137	3.923	8.887	NOK	63,800	44.414,65	0,08
CH0012005267	Novartis AG	STK	13.005	3.370	5.515	CHF	90,000	1.199.170,12	2,26
DK0060534915	Novo-Nordisk AS	STK	10.127	2.429	2.622	DKK	1.099,400	1.495.259,01	2,82
DK0060336014	Novozymes A/S	STK	1.322	155	158	DKK	317,900	56.441,93	0,11
GB00B3MBS747	Ocado Group PLC	STK	3.547	3.547	0	GBP	5,680	23.477,20	0,04
NL0010558797	OCI N.V.	STK	1.016	395	0	EUR	21,970	22.321,52	0,04
AT0000743059	OMV AG	STK	1.003	526	456	EUR	38,840	38.956,52	0,07
FR0000133308	Orange S.A.	STK	12.820	3.520	3.327	EUR	10,702	137.199,64	0,26
FR0000120321	Oréal S.A., L'	STK	1.518	399	422	EUR	427,100	648.337,80	1,22
FI0009014377	Orion Corp.	STK	804	469	200	EUR	38,020	30.568,08	0,06
NO0003733800	Orkla ASA	STK	5.133	1.788	1.223	NOK	77,100	33.858,43	0,06
DK0060252690	Pandora A/S	STK	584	304	372	DKK	609,200	47.780,71	0,09
CH0024608827	Partners Group Holding AG	STK	141	40	39	CHF	841,600	121.577,38	0,23
GB0006776081	Pearson PLC	STK	4.251	297	1.236	GBP	8,220	40.719,24	0,08
GB00BNNTLN49	Pennon Group PLC	STK	1.687	0	371	GBP	7,110	13.977,24	0,03
FR0000120693	Pernod-Ricard S.A.	STK	1.267	359	356	EUR	202,400	256.440,80	0,48
GB00BGXQNP29	Phoenix Group Holdings PLC	STK	5.057	0	960	GBP	5,318	31.338,50	0,06
IT0003796171	Poste Italiane S.p.A.	STK	2.838	0	0	EUR	9,916	28.141,61	0,05
PLPZU0000011	Powszechny Zakład Ubezpieczen	STK	4.118	5.081	4.684	PLN	39,410	36.612,50	0,07
NL0013654783	Prosus N.V.	STK	4.299	1.045	2.456	EUR	67,110	288.505,89	0,54
GB0007099541	Prudential PLC	STK	17.222	4.965	5.477	GBP	11,085	222.462,12	0,42
IT0004176001	Prysmian S.p.A.	STK	1.673	522	479	EUR	38,280	64.042,44	0,12
FR0000130577	Publicis Groupe S.A.	STK	1.418	285	330	EUR	73,500	104.223,00	0,20
NL0012169213	Qiagen N.V.	STK	1.349	551	534	EUR	41,140	55.497,86	0,10
NL0000379121	Randstad N.V.	STK	709	132	221	EUR	48,310	34.251,79	0,06
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group	STK	4.607	1.149	1.246	GBP	59,120	317.387,22	0,60
IT0003828271	Recordati - Ind.Chim.Farm. SpA	STK	559	0	73	EUR	43,750	24.456,25	0,05
ES0173093024	Red Electrica Corporacion S.A.	STK	2.371	431	600	EUR	15,385	36.477,84	0,07
GB00B2B0DG97	Relx PLC	STK	12.113	3.515	3.942	GBP	26,210	369.960,65	0,70
FR0000130395	Rémy Cointreau S.A.	STK	138	0	0	EUR	146,950	20.279,10	0,04
FR0000131906	Renault S.A.	STK	1.209	181	231	EUR	38,580	46.643,22	0,09
GB00B082RF11	Rentokil Initial PLC	STK	15.365	6.325	3.307	GBP	6,150	110.114,49	0,21
IT0005282865	Reply S.p.A.	STK	141	0	0	EUR	104,100	14.678,10	0,03
ES0173516115	Repsol S.A.	STK	8.238	1.166	1.830	EUR	13,330	109.812,54	0,21
FR0010451203	Rexel S.A.	STK	1.435	482	532	EUR	22,610	32.445,35	0,06
DK0010219153	Rockwool International A/S	STK	58	27	22	DKK	1.763,000	13.732,83	0,03
GB00BVFNZH21	Rotork PLC	STK	5.367	1.527	1.388	GBP	3,048	19.062,66	0,04
GB00BDVZY77	Royal Mail PLC	STK	6.171	4.139	2.892	GBP	2,209	15.885,03	0,03
DK0060634707	Royal Unibrew AS	STK	255	153	158	DKK	610,000	20.890,55	0,04
GB0003096442	RS Group PLC	STK	2.851	155	643	GBP	7,602	25.255,84	0,05
FR0013269123	Rubis S.C.A.	STK	589	0	0	EUR	22,240	13.099,36	0,02
IE00BYTBXV33	Ryanair Holdings PLC	STK	3.329	704	736	EUR	17,215	57.308,74	0,11
GB00B8C3BL03	Sage Group PLC, The	STK	6.407	6.407	0	GBP	9,248	69.046,13	0,13
GB00B019KW72	Sainsbury PLC, J.	STK	10.873	3.121	3.036	GBP	2,690	34.083,05	0,06
NO0010310956	Salmar ASA	STK	442	442	0	NOK	432,900	16.370,09	0,03
FI0009003305	Sampo OYJ	STK	3.063	871	1.053	EUR	41,120	125.950,56	0,24
SE0000667891	Sandvik AB	STK	6.753	1.974	1.988	SEK	210,200	120.455,74	0,23
FR0000120578	Sanofi S.A.	STK	7.156	1.749	1.808	EUR	98,200	702.719,20	1,32
FR0013154002	Sartorius Stedim Biotech S.A.	STK	141	23	29	EUR	228,700	32.246,70	0,06
CH0024638196	Schindler Holding AG	STK	231	32	49	CHF	209,700	49.629,32	0,09
FR0000121972	Schneider Electric SE	STK	3.572	969	1.022	EUR	166,460	594.595,12	1,12
GB00BP9LHF23	Schroders PLC	STK	5.985	5.985	0	GBP	4,373	30.498,64	0,06
FR0010411983	SCOR SE	STK	922	625	744	EUR	26,890	24.792,58	0,05
FR0000121709	SEB S.A.	STK	149	0	0	EUR	94,650	14.102,85	0,03

SE0000163594	Securitas AB	STK	2,944	3,791	2,351	SEK	88,460	22,099,52	0,04
GB00B5ZN1N88	Segro PLC	STK	7,763	2,433	2,229	GBP	7,168	64,843,19	0,12
GB00B1FH8J72	Severn Trent PLC	STK	1,601	247	369	GBP	25,660	47,872,35	0,09
CH0239229302	SFS Group AG	STK	156	156	0	CHF	117,800	18,827,72	0,04
CH1256740924	SGS S.A.	STK	912	912	0	CHF	84,560	79,011,03	0,15
CH0435377954	SIG Combibloc Services AG	STK	2,075	1,086	1,190	CHF	24,680	52,467,60	0,10
NL0011821392	Signify N.V.	STK	853	325	301	EUR	25,670	21,896,51	0,04
CH0418792922	Sika AG	STK	911	185	222	CHF	255,700	238,658,57	0,45
DK00060495240	SimCorp A/S	STK	215	36	67	DKK	723,000	20,876,45	0,04
SE0000148884	Skandinaviska Enskilda Banken	STK	10,160	2,068	2,648	SEK	119,150	102,727,28	0,19
SE0000113250	Skanska AB	STK	2,474	300	592	SEK	151,150	31,732,62	0,06
SE0000108227	SKF AB	STK	2,017	852	2,967	SEK	187,600	32,109,74	0,06
GB0009223206	Smith & Nephew PLC	STK	5,444	1,176	1,603	GBP	12,680	80,440,39	0,15
GB00B1WY2338	Smiths Group PLC	STK	2,288	438	557	GBP	16,440	43,832,34	0,08
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group PLC	STK	1,553	242	406	EUR	30,530	47,413,09	0,09
IT0003153415	Snam S.p.A.	STK	13,344	3,527	2,688	EUR	4,787	63,877,73	0,12
FR0000130809	Société Générale S.A.	STK	5,055	1,134	1,268	EUR	23,800	120,309,00	0,23
FR0000121220	Sodexo S.A.	STK	481	84	116	EUR	100,850	48,508,85	0,09
GB00BYZDVK82	Softcat PLC	STK	805	1,203	398	GBP	14,160	13,282,99	0,03
FR0013227113	Soitec S.A.	STK	153	0	0	EUR	154,950	23,707,35	0,04
BE0003470755	Solvay S.A.	STK	461	106	114	EUR	102,300	47,160,30	0,09
CH0012549785	Sonova Holding AG	STK	299	58	85	CHF	238,200	72,969,42	0,14
FR0000050809	Sopra Steria Group S.A.	STK	97	0	0	EUR	182,800	17,731,60	0,03
GB0003308607	Spectris PLC	STK	671	208	240	GBP	35,950	28,109,83	0,05
FR0012757854	Spie S.A.	STK	922	0	0	EUR	29,600	27,291,20	0,05
GB00BWFQGN14	Spirax-Sarco Engineering PLC	STK	462	80	108	GBP	103,650	55,801,78	0,11
SE0000120669	SSAB AB	STK	3,795	5,698	11,648	SEK	74,700	24,056,39	0,05
GB0007908733	SSE PLC	STK	6,843	2,385	2,278	GBP	18,410	146,803,74	0,28
GB00BGBN7C04	SSP Group PLC	STK	4,984	4,984	0	GBP	2,508	14,566,07	0,03
GB0007669376	St. James's Place PLC	STK	3,123	711	1,228	GBP	10,875	39,576,57	0,07
GB0004082847	Standard Chartered PLC	STK	14,794	3,096	4,459	GBP	6,830	117,745,17	0,22
GB00BF8Q6K64	Standard Life Aberdeen PLC	STK	12,483	8,824	9,601	GBP	2,182	31,740,27	0,06
NL00150001Q9	Stellantis N.V.	STK	14,712	4,268	3,605	EUR	16,090	236,716,08	0,45
NL0000226223	STMicroelectronics N.V.	STK	4,246	1,125	949	EUR	45,560	193,447,76	0,36
FI0009005961	Stora Enso Oyj	STK	3,915	1,589	2,902	EUR	10,625	41,596,88	0,08
NO0003053605	Storebrand ASA	STK	2,758	1,815	2,011	NOK	83,660	19,740,28	0,04
CH1175448666	Straumann Holding AG	STK	702	171	189	CHF	145,150	104,395,57	0,20
LU0075646355	Subsea 7 S.A.	STK	1,345	1,345	0	NOK	133,650	15,379,15	0,03
SE0000112724	Svenska Cellulosa AB	STK	3,333	2,054	4,024	SEK	137,450	38,875,69	0,07
SE0007100599	Svenska Handelsbanken AB	STK	10,189	3,330	2,798	SEK	90,340	78,110,55	0,15
CH0012255151	Swatch Group AG, The	STK	169	169	0	CHF	261,100	45,208,65	0,09
SE0014960373	Sweco AB	STK	1,237	1,589	1,233	SEK	118,700	12,460,01	0,23
SE0000242455	Swedbank AB	STK	5,491	877	1,216	SEK	181,850	84,734,99	0,16
SE0000872095	Swedish Orphan Biovitrum AB	STK	1,132	292	373	SEK	210,400	20,211,11	0,04
CH0014852781	Swiss Life Holding AG	STK	184	32	43	CHF	523,000	98,593,31	0,19
CH0008038389	Swiss Prime Site AG	STK	448	185	199	CHF	77,650	35,640,80	0,07
CH0126881561	Swiss Re AG	STK	1,808	453	425	CHF	90,040	166,786,87	0,31
CH0008742519	Swisscom AG	STK	152	33	36	CHF	557,800	86,866,04	0,16
GB0008782301	Taylor Wimpey PLC	STK	21,943	1,236	1,955	GBP	1,028	26,273,30	0,05
CH0012100191	Tecan Group AG	STK	76	42	28	CHF	343,200	26,723,22	0,05
SE0005190238	Tele2 AB	STK	3,005	632	673	SEK	89,120	22,725,72	0,04
IT0003497168	Telecom Italia S.p.A.	STK	61,930	0	0	EUR	0,258	15,965,55	0,03
SE0000108656	Telefonaktiebolaget L.M.Erics.	STK	18,380	5,223	5,971	SEK	58,410	91,102,60	0,17
ES0178430E18	Telefónica S.A.	STK	35,970	7,846	7,275	EUR	3,716	133,664,52	0,25
FR0000051807	Téléperformance SE	STK	378	106	90	EUR	153,450	58,004,10	0,11
SE0000667925	Telia Company AB	STK	13,378	1,396	3,063	SEK	23,650	26,848,52	0,05
CH0012453913	Temenos AG	STK	492	282	208	CHF	71,140	35,859,72	0,07
LU0156801721	Tenaris S.A.	STK	2,921	420	338	EUR	13,715	40,061,52	0,08
IT0003242622	Terna Rete Elettrica Nazio.SpA	STK	8,902	2,147	1,819	EUR	7,806	69,489,01	0,13
GB00BLGZ9862	Tesco PLC	STK	45,141	9,770	13,753	GBP	2,484	130,665,08	0,25
SE0006422390	Thule Group AB (publ)	STK	824	661	321	SEK	317,100	22,172,85	0,04
FI0009000277	TietoEVRY Oyj	STK	577	756	179	EUR	25,280	14,586,56	0,03
NO0012470089	Tomra Systems ASA	STK	1,491	269	288	NOK	172,500	22,004,32	0,04
DK0060477503	Topdanmark AS	STK	264	264	0	DKK	335,200	11,884,69	0,02
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	15,577	4,050	4,991	EUR	52,550	818,571,35	1,54
GB00BK9RKT01	Travis Perkins PLC	STK	1,370	232	230	GBP	8,124	12,969,62	0,02
SE0000114837	Trelleborg AB	STK	1,475	0	0	SEK	261,400	32,718,67	0,06
GB00BG49KP99	Tritax Big Box REIT PLC	STK	14,177	5,255	5,030	GBP	1,250	20,650,53	0,04
DK0060636678	Tryg AS	STK	2,127	362	536	DKK	147,650	42,177,50	0,08
FR0000054470	Ubisoft Entertainment S.A.	STK	581	581	0	EUR	25,880	15,036,28	0,03
CH0244767585	UBS Group AG	STK	18,908	4,602	6,769	CHF	18,095	350,535,59	0,66
BE0003739530	UCB S.A.	STK	810	209	193	EUR	81,200	65,772,00	0,12
BE0974320526	Umicore S.A.	STK	1,263	320	377	EUR	25,590	32,320,17	0,06
FR0013326246	Unibail-Rodamco-Westfield SE	STK	533	75	189	EUR	48,150	25,663,95	0,05
IT0005239360	UniCredit S.p.A.	STK	12,140	2,761	4,335	EUR	21,265	258,157,10	0,49
GB00B10RZP78	Unilever PLC	STK	16,447	4,424	4,638	GBP	40,975	785,312,39	1,48
GB0006928617	Unite Group PLC	STK	2,234	734	789	GBP	8,700	22,648,49	0,04
GB00B39J2M42	United Utilities Group PLC	STK	4,342	669	863	GBP	9,616	48,654,28	0,09
FI0009005987	UPM Kymmene Corp.	STK	3,347	386	1,190	EUR	27,270	91,272,69	0,17
FR0013176526	Valéo S.E.	STK	1,231	247	340	EUR	19,630	24,164,53	0,05
FI4000074984	Valmet Oyj	STK	972	533	418	EUR	25,480	24,766,56	0,05
FR0000124141	Veolia Environnement S.A.	STK	4,192	1,341	1,437	EUR	28,950	121,358,40	0,23
FR0013447729	Verallia SA	STK	463	463	0	EUR	34,380	15,917,94	0,03
AT0000746409	Verbund AG	STK	474	267	194	EUR	73,450	34,815,30	0,07
DK0061539921	Vestas Wind Systems AS	STK	6,219	1,419	1,682	DKK	181,460	151,558,87	0,29
ES0183746314	Vidrala S.A.	STK	150	201	51	EUR	86,500	12,975,00	0,02
FR0000125486	VINCI S.A.	STK	3,694	1,042	934	EUR	106,380	392,967,72	0,74
GB00BD6GNO30	Virgin Money UK PLC	STK	8,829	2,239	4,015	GBP	1,496	15,386,32	0,03
ES0184262212	Viscofan S.A.	STK	228	228	0	EUR	63,300	14,432,40	0,03
GB0001859296	Vistry Group PLC	STK	1,939	1,596	1,009	GBP	6,605	14,924,08	0,03
FR0000127771	Vivendi S.A.	STK	4,079	793	1,142	EUR	8,406	34,288,07	0,06
GB00BH4HKS39	Vodafone Group PLC	STK	142,111	47,308	89,395	GBP	0,740	122,495,50	0,23
AT0000937503	voestalpine AG	STK	664	107	1,232	EUR	32,900	21,845,60	0,04
SE0000115446	Volvo (publ), AB	STK	9,912	2,662	2,628	SEK	223,000	187,570,36	0,35
SE0016844831	Volvo Car AB	STK	3,040	1,009	846	SEK	42,820	11,046,34	0,02
BE0974349814	Warehouses De Pauw N.V.	STK	956	215	73	EUR	25,120	24,014,72	0,05
FI0009003727	Wärtsilä Corp	STK	3,429	1,870	925	EUR	10,315	35,370,14	0,07
GB00BJDQQ870	Watches Of Switzerland Group PLC	STK	1,273	1,901	628	GBP	6,105	9,056,31	0,02

GB0009465807	Weir Group PLC, The	STK	1.594	78	346	GBP	17,560	32.617,42	0,06
FR0000121204	Wendel SE	STK	158	101	109	EUR	94,000	14.852,00	0,03
GB00B2PDGW16	WH Smith PLC	STK	819	819	0	GBP	15,480	14.773,78	0,03
GB00B1KJJ408	Whitbread PLC	STK	1.204	155	346	GBP	33,860	47.506,19	0,09
AT0000831706	Wienerberger AG	STK	832	887	776	EUR	28,040	23.329,28	0,04
SE0018012635	Wihlborgs Fastigheter AB	STK	1.633	1.298	715	SEK	78,000	10.808,83	0,02
NL0000395903	Wolters Kluwer N.V.	STK	1.590	375	419	EUR	116,300	184.917,00	0,35
FR0011981968	Worldline S.A.	STK	1.472	368	323	EUR	33,500	49.312,00	0,09
JE00B8KF9B49	WPP PLC	STK	7.225	1.337	1.219	GBP	8,234	69.324,30	0,13
NO0010208051	Yara International ASA	STK	1.085	255	286	NOK	379,000	35.181,16	0,07
CH0011075394	Zurich Insurance Group AG	STK	939	242	256	CHF	424,900	408.771,17	0,77
						<b>EUR</b>		<b>44.700.100,23</b>	<b>84,28</b>
<b>Andere Wertpapiere</b>									
<b>Ausland</b>									
CH0012032048	Roche Holding AG - Genussscheine	STK	4.395	1.118	1.160	CHF	274,650	1.231.527,59	2,32
						<b>EUR</b>		<b>1.231.527,59</b>	<b>2,32</b>
						<b>EUR</b>		<b>52.783.268,96</b>	<b>99,52</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>									
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>									
<b>EUR-Guthaben bei:</b>									
Verwahrstelle		EUR	9.765,73			%	100,000	9.765,73	0,02
<b>Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen</b>									
Verwahrstelle		CHF	1.761,05			%	100,000	1.804,26	0,00
Verwahrstelle		DKK	8.621,02			%	100,000	1.157,81	0,00
Verwahrstelle		NOK	83.520,85			%	100,000	7.145,56	0,01
Verwahrstelle		PLN	3.803,06			%	100,000	857,97	0,00
Verwahrstelle		SEK	41.965,86			%	100,000	3.561,18	0,01
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>									
Verwahrstelle		GBP	1.595,60			%	100,000	1.859,35	0,00
Verwahrstelle		USD	1.520,68			%	100,000	1.393,84	0,00
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>									
Dividendenforderungen Aktien		EUR	20.532,60					20.532,60	0,04
Dividendenforderungen Aktien		GBP	28.750,38					33.502,74	0,06
Dividendenforderungen Aktien		SEK	455,70					38,67	0,00
Dividendenforderungen Aktien		USD	2.770,15					2.539,09	0,00
Dividendenforderungen REITS		EUR	491,73					491,73	0,00
Dividendenforderungen REITS		GBP	1.151,72					1.342,10	0,00
Quellensteuererstattungsansprüche		CHF	164.074,06					168.100,06	0,32
Quellensteuererstattungsansprüche		DKK	90.927,81					12.211,71	0,02
Quellensteuererstattungsansprüche		EUR	12.307,84					12.307,84	0,02
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>									
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung		EUR	-24.977,08					-24.977,08	-0,05
<b>Wert des Teilsondervermögens</b>									
<b>Anteilwert</b>									
<b>Umlaufende Anteile</b>									
						<b>EUR</b>		<b>53.036.904,12</b>	<b>100,00</b> <sup>1)</sup>
						<b>EUR</b>		<b>47,76</b>	
						<b>STK</b>		<b>1.110.400</b>	

Fußnoten:

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

#### Wertpapierkurse bzw. Marktsätze

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2023

#### Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.06.2023

Britisches Pfund	(GBP)	0,85815 = 1 EUR
Dänische Krone	(DKK)	7,44595 = 1 EUR
Norwegische Krone	(NOK)	11,6885 = 1 EUR
Polnischer Zloty	(PLN)	4,43265 = 1 EUR
Schwedische Krone	(SEK)	11,78425 = 1 EUR
Schweizer Franken	(CHF)	0,97605 = 1 EUR
US-Dollar	(USD)	1,08885 = 1 EUR

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE000BAY0017	Bayer AG	STK	1.352	7.613	
DE0005158703	Bechtle AG	STK	0	498	
DE000A161408	HelloFresh SE	STK	164	1.079	
DE000PSM7770	ProSiebenSat.1 Media SE	STK	0	637	
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK	715	1.606	
DE000A31C3C0	TAG Immobilien AG - Anrechte	STK	65	65	
DE0005089031	United Internet AG	STK	309	926	
DE000A2GSYQ9	Vonovia SE - Anrechte	STK	4.069	4.069	
<b>Ausland</b>					
NL0015000W81	Aalberts N.V. - Anrechte	STK	0	625	
NL00150010Z1	ABN AMRO Bank N.V. - Anrechte	STK	3.385	3.385	
NL0015001B69	ABN AMRO Bank N.V. - Anrechte	STK	2.628	2.628	
CH1169360919	Accelleron Industries Ltd.	STK	420	420	

ES0167050220	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA	STK	97	97
ES06670509M2	ACS, Act.de Constr.y Serv. SA - Anrechte	STK	1.305	1.305
ES06670509L4	ACS, Actividades de Construcción y Servicios S.A. - Anrechte	STK	1.461	1.461
BE6336384530	Aedifica S.A. - Anrechte	STK	0	230
BE6337173668	Aedifica S.A. - Anrechte	STK	302	302
NL0015000SA1	AEGON N.V. - Anrechte	STK	0	11.038
NL00150011D6	AEGON N.V. - Anrechte	STK	11.409	11.409
NL0015001GE6	AEGON N.V. - Anrechte	STK	9.690	9.690
NL0012817175	Alfen N.V.	STK	123	123
SE0017615644	Alleima AB	STK	1.443	1.443
FR001400AXF0	Alstom S.A. - Anrechte	STK	1.876	1.876
IT0004056880	Amplifon S.p.A.	STK	742	742
NL0015001FK5	ArcelorMittal S.A. - Anrechte	STK	3.098	3.098
LU1673108939	Aroundtown SA	STK	0	5.662
LU2489901806	Aroundtown SA - Anrechte	STK	0	5.662
GB0000536739	Ashtead Group PLC	STK	643	3.609
GB0006731235	Associated British Foods PLC	STK	356	2.546
GB00BVGBWW93	Assura PLC	STK	38.299	38.299
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	STK	288	3.374
FR0000051732	Atos SE	STK	0	673
GB00BVYVFW23	Auto Trader Group PLC	STK	1.367	8.089
GB00BDD85M81	Avast Plc.	STK	688	5.714
GB00BBG9VN75	AVEVA Group PLC	STK	850	850
AT0000BAWAG2	BAWAG Group AG	STK	77	525
SE0017768716	Boliden AB	STK	0	2.496
SE0020050425	Boliden AB	STK	1.637	1.637
CH0002432174	Bucher Industries AG	STK	0	29
DK0010181759	Carlsberg AS	STK	191	805
SE0020202745	Castellum AB	STK	649	649
SE0020202737	Castellum AB - Anrechte	STK	1.298	1.298
CH0010570759	Chocoladef. Lindt & Sprüngli	STK	0	1
CH0210483332	Cie Financière Richemont AG	STK	739	4.056
BE6343690846	Cofinimmo S.A. - Anrechte	STK	156	156
FR001400HCY0	Covivio S.A. - Anrechte	STK	286	286
CH0012138530	Credit Suisse Group AG	STK	13.604	29.113
CH1228538257	Credit Suisse Group AG - Anrechte	STK	17.049	17.049
GB0001826634	Diploma PLC	STK	286	1.054
GB00BY9D0Y18	Direct Line Insurance Grp PLC	STK	0	9.453
SE0007691613	Dometic Group AB	STK	0	1.279
CH0023405456	Dufry AG	STK	193	638
ES0127797027	EDP Renováveis S.A.	STK	18	18
ES0627797907	EDP Renováveis S.A. - Anrechte	STK	1.363	1.363
FR0010242511	Electricité de France (E.D.F.)	STK	510	4.104
FR001400GX90	Elis S.A. - Anrechte	STK	1.142	1.142
FR001400GCH7	EssilorLuxottica S.A. - Anrechte	STK	1.839	1.839
JE00BJVNSS43	Ferguson PLC	STK	363	1.757
ES0118900010	Ferrovial S.A.	STK	0	3.296
ES0118900192	Ferrovial S.A.	STK	53	53
ES06189009K1	Ferrovial S.A. - Anrechte	STK	39	39
ES0137650018	Fluidra S.A.	STK	0	591
GB0009252882	GlaxoSmithKline PLC	STK	0	32.239
GB00BMX86B70	Haleon PLC	STK	34.045	34.045
BMG4593F1389	Hiscox Ltd.	STK	2.247	2.247
GB0005576813	Howden Joinery Group PLC	STK	884	5.191
ES0144583269	Iberdrola S.A.	STK	1.009	1.009
ES06445809P3	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	34.379	34.379
ES06445809O6	Iberdrola S.A. - Anrechte	STK	36.353	36.353
SE0000190126	Industrivården AB	STK	0	1.037
SE0000107203	Industrivården AB	STK	1.020	1.020
NL0000009827	Koninklijke DSM N.V.	STK	292	1.369
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	574	3.738
BE0003604155	Lotus Bakeries S.A.	STK	2	2
GB00B7T77214	NatWest Group PLC	STK	3.468	39.272
SE0005034550	Neobo Fastigheter AB	STK	405	405
DK0060952919	Netcompany Group A/S	STK	252	525
GB0032089863	NEXT PLC	STK	0	884
NL0015001EI2	NN Group N.V. - Anrechte	STK	1.468	1.468
NL00150010L1	NN Group N.V. - Anrechte	STK	2.074	2.074
SE0012116390	Nordic Entertainment Group AB	STK	162	380
US6687711084	NortonLifeLock Inc.	STK	158	158
PLPKO0000016	Powszechna K.O.(PKO)Bk Polski	STK	0	5.215
NL00150011T2	Prosus N.V. - Anrechte	STK	6.034	6.034
BE0003810273	Proximus S.A.	STK	795	1.751
AT0000606306	Raiffeisen Bank Intl AG	STK	70	480
FR001400BQC9	Rémy Cointreau S.A. - Anrechte	STK	138	138
SE0009554454	Samhallsbyggnadsbola.I Nord AB	STK	3.323	8.790
GB0002405495	Schroders PLC	STK	235	1.016
SE0018689234	Securitas AB	STK	1.200	1.200
SE0018689226	Securitas AB - Anrechte	STK	8.404	8.404
CH0002497458	SGS S.A.	STK	0	37
GB00BP6MXD84	Shell PLC	STK	83.769	83.769
NL0015001FL3	Shell PLC - Anrechte	STK	41.943	41.943
NL00150016P9	Shell PLC - Anrechte	STK	41.476	41.476
ES0143416115	Siemens Gamesa Renew. En. S.A.	STK	0	1.364
GB00BP92CJ43	Tate & Lyle PLC	STK	383	2.825
NO0010063308	Telenor ASA	STK	4.400	4.400
SE0011205202	Vitrolife AB	STK	138	498
SE0017780133	Wallenstam AB	STK	3.475	5.293
BE6343317028	Warehouses De Pauw N.V. - Anrechte	STK	930	930
JE00BN574F90	Wizz Air Holdings PLC	STK	125	438
NL0015001CV9	Wolters Kluwer N.V. - Anrechte	STK	1.590	1.590
NL00150010J5	Wolters Kluwer N.V. - Anrechte	STK	1.745	1.745





**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		237.143,09	0,214
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		1.470.434,62	1,324
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		1.135,87	0,001
4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		92,35	0,000
davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern	92,35		0,000
5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-32.314,97	-0,029
6. Abzug ausländischer Quellensteuer		-117.168,80	-0,106
7. Sonstige Erträge		206,67	0,000
davon: Sonstiges	206,67		0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>1.559.528,83</b>	<b>1,404</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Zinsen aus Kreditaufnahme		-18,08	0,000
2. Verwaltungsvergütung		-93.805,92	-0,084
3. Sonstige Aufwendungen		-210,83	0,000
davon: Bankgebühren	-178,51		0,000
davon: Sonstiges	-32,32		0,000
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-94.034,83</b>	<b>-0,085</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>1.465.494,00</b>	<b>1,320</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		2.372.660,52	2,137
2. Realisierte Verluste		-2.112.927,70	-1,903
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>259.732,82</b>	<b>0,234</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>1.725.226,82</b>	<b>1,554</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		4.268.570,02	3,844
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		1.711.460,53	1,541
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>5.980.030,55</b>	<b>5,385</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>7.705.257,37</b>	<b>6,939</b>

**Entwicklung des Teilsondervermögens**

	EUR	2022 / 2023 EUR
<b>I. Wert des Teilsondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>		<b>49.565.252,55</b>
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr		-1.333.852,00
2. Mittelzufluss (netto)		-2.912.770,06
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	7.455.330,90	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-10.368.100,96	
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich		13.016,26
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		7.705.257,37
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	4.268.570,02	
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	1.711.460,53	
<b>II. Wert des Teilsondervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>		<b>53.036.904,12</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsondervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>7.826.039,71</b>	<b>7,048</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		6.100.812,89	5,494
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		1.725.226,82	1,554
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>6.349.207,71</b>	<b>7,165</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		6.349.207,71	7,165
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>1.476.832,00</b>	<b>1,330</b>
1. Endausschüttung		1.476.832,00	1,330

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

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsondervermöge am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2022/2023	53.036.904,12	47,76
2021/2022	49.565.252,55	41,99
2020/2021	48.961.655,32	46,28
2019/2020	27.459.918,18	36,85

# Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF)

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

### Sonstige Angaben

Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF)

International Security Identification Number (ISIN)

Anteilwert	EUR	DE000ETF9603
	STK	47,76
Umlaufende Anteile		1.110.400
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Mindeststückelung	Anteil	1,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,19
Ertragsverwendung		ausschüttend

Bestand der Wertpapiere am Teilsongervermögen (in %)

99,52

Bestand der Derivate am Teilsongervermögen (in %)

0,00

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2023 grundsätzlich zum letzten gehandelten Börsen- oder Marktkurs, der eine verlässliche Bewertung gewährleistet.

Vermögensgegenstände, die weder zum Handel an den 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 30.06.2023 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 bezahlter CSDR Gebühren	EUR	139,01
------------------------------------	-----	--------

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

Negative Einlagezinsen	EUR	61,31
------------------------	-----	-------

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

0,19

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

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

Die Gesellschaft erhält aus dem jeweiligen Teilsongervermögen 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 Teilsongervermögen 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 Teilsongervermögen 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 vor Ertragsausgleich

Pauschalgebühren gem. § 101 (2) Nr. 2 KAGB (absolut)	EUR	95.795,22
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	-17,52
Davon für die Verwahrstelle	%	96,65
Davon für Dritte	%	20,87

### Transaktionskosten

EUR

28.064,60

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 Teilsongervermögen angefallen und mit der Pauschalgebühr abgegolten.

Der Anteil der Wertpapiertransaktionen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Teilsongervermögens 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 Teilsongervermögen 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)	0,20%
Höhe der Annual Tracking Difference	0,20%

Der im Geschäftsjahr 2022/2023 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

### 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 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.

**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 (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) 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?



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 \_\_\_\_\_ an nachhaltigen Investitionen **67,98 %**



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 STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return Index (der "Index"). Das Teilsondervermögen fördert ökologische und/oder soziale Merkmale, einschließlich durch die Integration des Umwelt-, Sozial- und Governance-Ratings ("ESG") des ESG-Bereichs des Datenanbieters Sustainalytics. Der STOXX® Europe 600 ESG Broad Market EUR

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>STOXX Europe 600 ESG+</b>	<b>75,15</b>	<b>100%</b>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Amundi Group berücksichtigt im Rahmen ihrer investmentbezogenen Ausschlusspolitik als Teil der Grundsätze für nachhaltiges Investieren von Amundi Group bereits bestimmte wichtigste nachteilige Auswirkungen (Principal Adverse Impacts). Diese Ausschlüsse, die

zusätzlich zu den oben genannten Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschluss von kontroversen Waffen, Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact, Kohle und Tabak.

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

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

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

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

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



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

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 Sektor bezogen), der Integration von ESG-Ratings in den Anlageprozess, Engagement und Abstimmungsansätzen:

- Ausschluss: Amundi Group hat normative, tätigkeitsbasierte und Sektor basierte Ausschlussregeln definiert, die einige der wichtigsten nachteiligen Nachhaltigkeitsindikatoren abdecken, die in der Offenlegungsverordnung aufgeführt sind.

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

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



## Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 01.07.2022 bis 30.06.2023**

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NESTLE SA-REG	Nicht-zyklische Konsumgüter	3,48 %	USA
ASML HOLDING NV	IT	3,16 %	NLD
NOVO NORDISK A/S-B	Gesundheit	2,83 %	DNK
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	Zyklische Konsumgüter	2,65 %	FRA
ASTRAZENECA GBP	Gesundheit	2,41 %	GBR
ROCHE HLDG AG-GENUSS	Gesundheit	2,33 %	USA
NOVARTIS	Gesundheit	2,27 %	CHE
HSBC HOLDING PLC GBP	Finanzwesen	1,74 %	GBR
SAP SE / XETRA	IT	1,60 %	DEU
TOTALENERGIES SE PARIS	Energie	1,55 %	FRA
UNILEVER PLC (GBP)	Nicht-zyklische Konsumgüter	1,49 %	GBR
SIEMENS AG-REG	Industrie	1,35 %	DEU
SANOFI	Gesundheit	1,33 %	USA
L OREAL	Nicht-zyklische Konsumgüter	1,23 %	FRA
SCHNEIDER ELECT SE	Industrie	1,13 %	USA

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

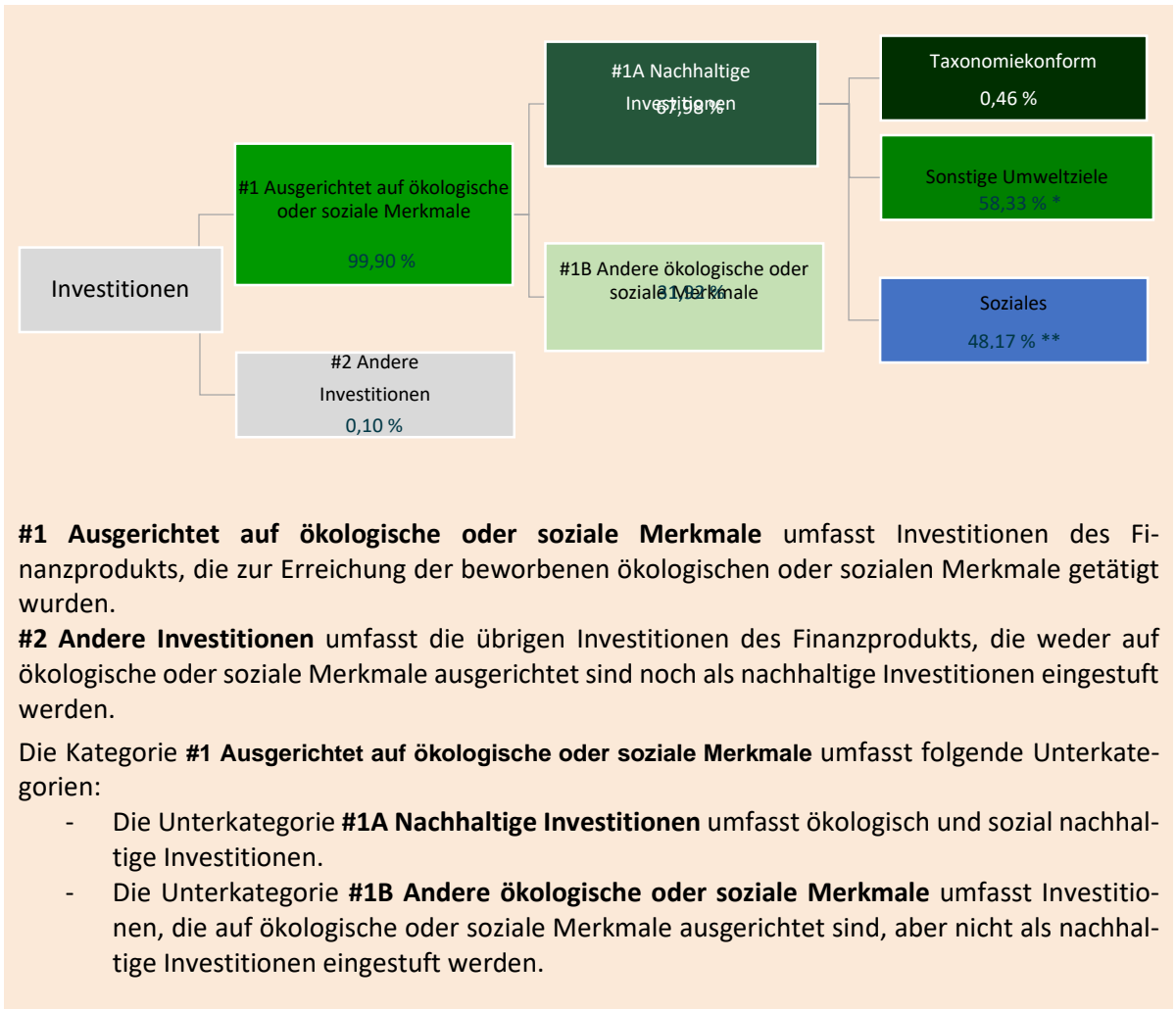




## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



**#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.

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

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
<i>Finanzwesen</i>	19,01 %
<i>Gesundheit</i>	16,26 %
<i>Industrie</i>	14,75 %
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	12,16 %
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	11,36 %
<i>IT</i>	8,23 %
<i>Grundstoffe</i>	6,37 %
<i>Energie</i>	4,16 %
<i>Öffentliche Dienstleistungen</i>	3,30 %
<i>Kommunikationsdienste</i>	3,21 %
<i>Immobilien</i>	1,09 %
<i>Liquide Mittel</i>	0,09 %

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 0,46% in nachhaltige Investitionen investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen. Diese Investitionen trugen zu den Zielen der EU-Taxonomie im Hinblick auf die Verpflichtung zum Klimaschutz oder Klimaschutzmaßnahmen bei.

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

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

Ja:

In fossiles Gas

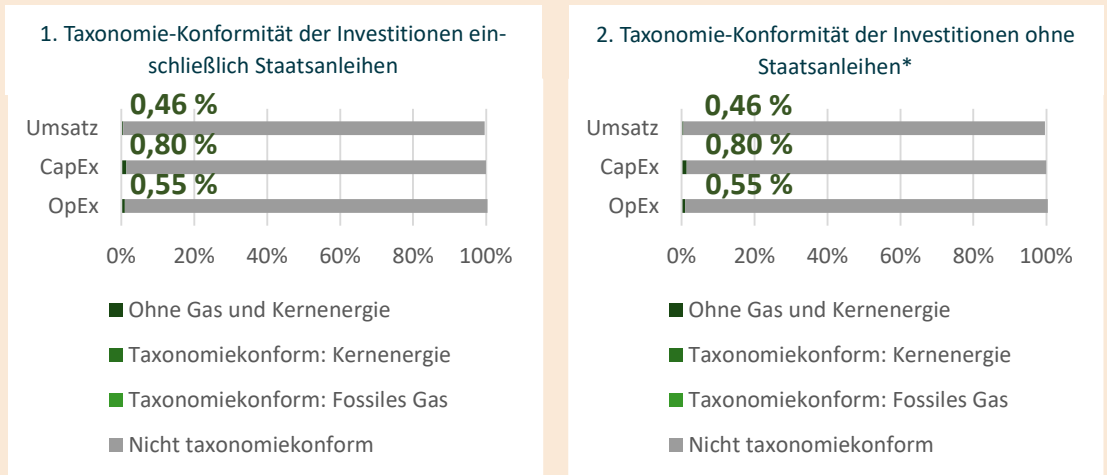
In Kernenergie

Nein

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

<sup>1</sup>Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels (Klimaschutz) 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 Risikopos Staaten

#### Ermöglichende

**Tätigkeiten** wirken unmittelbar ermö- glichend darauf hin, dass andere Tätig- keiten einen we- sentlichen Beitrag zu den Umwelt- zielen leis- ten.

**Übergang- stätigkeiten** sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2- armen Alternativen gibt und die unter an- derem Treibhaus- gasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

Zum 30.06.2023 betrug der Anteil der Investitionen des Fonds an Übergangstätigkeiten anhand von Umsatz- bzw. Ertragszahlen und/oder Daten zu grünen „Use of Proceeds“-Anleihen als Indikator 0% und der Anteil der Investitionen an ermöglichenden Tätigkeiten betrug 0,01%.

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

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



**Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investition 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 **58,33 %**. \* Ein Teil dieser Investitionen trägt auch zu einem sozialen Ziel bei.

Der Anteil von **58,33 %** 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 **48,17%**. \*\* Ein Teil dieser Investitionen trägt auch zu einem Umweltziel bei.



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

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



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

Dieses Produkt wird passiv verwaltet. Seine Anlagestrategie besteht darin, den Index nachzubilden und gleichzeitig den damit verbundenen Tracking Error zu minimieren. Durch verbindliche Elemente in der Indexmethodik wird sichergestellt, dass die ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu jedem Zeitpunkt der Neugewichtung erfüllt werden. Insbesondere verfolgt der 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?**

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

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit

denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

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.

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>STOXX Europe 600 ESG+</b>	75,15	100%
<b>STOXX® Europe 600 Index</b>	74,37	100%

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

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

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>STOXX Europe 600 ESG+</b>	75,15	100,00%

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

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

	1 Jahr
	30/06/2023
<b>Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF)</b>	16,89%
<b>STOXX Europe 600 ESG+</b>	16,69%
<b>Spread</b>	0,20%

- **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
	30/06/2023
<b>Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF)</b>	16,89%
<b>STOXX Europe 600</b>	13,44%
<b>Spread</b>	3,45%

#### 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 2022 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 2022 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 22. Juni 2022 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2022 fand am 01. Februar 2022 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 31.12.2022 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds. Amundi Luxembourg S.A. wurde am 01.07.2022 zur Verwaltungsgesellschaft des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) ernannt.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Kalenderjahrs 2022 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	97	8.867.445	1.732.476	10.599.921
Davon				
- Ermittelte Mitarbeiter	12	1.976.045	695.120	2.671.164
- Alle sonstigen Mitarbeiter	85	6.891.400	1.037.357	7.928.757

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 DER AUSLAGERUNGSUNTERNEHMEN

Vom 1. Juli 2022 bis 5. Dezember 2022: Amundi Deutschland GmbH war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter (147), betrug EUR 542.035 wovon EUR 311.838 auf die feste und EUR 230.198 auf die variable Vergütung entfielen. Die auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) entfallende anteilige Gesamtvergütung der Geschäftsführer (6) betrug EUR 55.233; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil der Gesamtvergütung der Führungskräfte (6) betrug EUR 19.301; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter mit Kontrollfunktion (3) betrug EUR 8.214; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor.

Vom 6. Dezember 2022 bis 30. Juni 2023: Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 22.233 EUR, davon 9.493 EUR in der festen Vergütung und 12.740 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 125.090 EUR, davon 83.215 EUR in der festen Vergütung und 41.875 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2022 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1.673 Mitarbeiter von denen 81 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 14. November 2023

Amundi Luxembourg S.A



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

## Vermögensübersicht zum 30. Juni 2023

	Kurswert in EUR	Kurswert in EUR	% des Teilsonderver- mögens
<b>I. Vermögensgegenstände</b>		<b>267.937.521,42</b>	<b>101,29</b>
1. Aktien		264.526.481,76	100,00
- Banken	8.175.906,69		3,09
- Bau und Baustoffe	2.790.972,80		1,06
- Bergbau	1.588.921,91		0,60
- Chemische Industrie	20.690.756,64		7,82
- Einzelhandel	5.993.340,56		2,27
- Elektrik / Elektronik	15.359.135,04		5,81
- Maschinenbau und Fahrzeugbau	48.908.146,81		18,49
- Pharmaindustrie / Biotech	34.454.023,73		13,02
- Real Estate	4.327.941,60		1,64
- Software	18.608.693,42		7,03
- Sonstige Finanzdienstleistungen	8.370.788,20		3,16
- Sonstige industrielle Werte	18.906.122,12		7,15
- Telekommunikation	20.360.648,53		7,70
- Textilien und Kleidung	9.390.866,16		3,55
- Transportation	11.306.849,40		4,27
- Versicherungen	35.293.368,15		13,34
2. Forderungen		3.178.688,23	1,20
3. Bankguthaben		232.351,43	0,09
<b>II. Verbindlichkeiten</b>		<b>-3.411.795,64</b>	<b>-1,29</b>
<b>III. Teilsondervermögen</b>		<b>264.525.725,78</b>	<b>100,00 <sup>1)</sup></b>

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

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

## Vermögensaufstellung zum 30. Juni 2023

ISIN	Gattungsbezeichnung	Markt	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Bestand 30.06.2023	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	% des Teilsondersvermögens	
							im Berichtszeitraum			
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>										
<b>Aktien</b>										
<b>Inland</b>										
DE000A1EWWW0	adidas AG		STK	44.408	20.311	12.275	EUR 177,780	7.894.854,24	2,98	
DE0008404005	Allianz SE		STK	87.983	49.493	36.866	EUR 213,200	18.757.975,60	7,09	
DE0006766504	Aurubis AG		STK	8.127	3.730	2.067	EUR 78,540	638.294,58	0,24	
DE000BASF111	BASF SE		STK	240.467	122.031	74.827	EUR 44,470	10.693.567,49	4,04	
DE000BAY0017	Bayer AG		STK	264.691	125.025	70.777	EUR 50,670	13.411.892,97	5,07	
DE0005190003	Bayerische Motoren Werke AG		STK	80.578	41.435	29.498	EUR 112,520	9.066.636,56	3,43	
DE0005200000	Beiersdorf AG		STK	26.364	12.027	6.624	EUR 121,250	3.196.635,00	1,21	
DE000A1DAH00	Brenntag SE		STK	38.896	18.709	12.908	EUR 71,400	2.777.174,40	1,05	
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec AG		STK	9.846	4.554	2.536	EUR 99,040	975.147,84	0,37	
DE000CBK1001	Commerzbank AG		STK	284.781	132.070	73.705	EUR 10,150	2.890.527,15	1,09	
DE0005439004	Continental AG		STK	29.102	13.524	7.557	EUR 69,100	2.010.948,20	0,76	
DE0006062144	Covestro AG		STK	51.038	23.548	13.332	EUR 47,580	2.428.388,04	0,92	
DE000DTR0CK8	Daimler Truck Holding AG		STK	146.841	168.069	21.228	EUR 33,000	4.845.753,00	1,83	
DE0005140008	Deutsche Bank AG		STK	549.530	256.035	143.381	EUR 9,618	5.285.379,54	2,00	
DE0005810055	Deutsche Börse AG		STK	49.502	23.067	12.897	EUR 169,100	8.370.788,20	3,16	
DE0005552004	Deutsche Post AG		STK	252.780	120.095	74.685	EUR 44,730	11.306.849,40	4,27	
DE0005557508	Deutsche Telekom AG		STK	930.361	483.052	292.378	EUR 19,976	18.584.891,34	7,03	
DE000PAG9113	Dr. Ing. h.c. F. Porsche AG		STK	30.967	35.641	4.674	EUR 113,750	3.522.496,25	1,33	
DE000EVNK013	Evonik Industries AG		STK	55.243	27.323	16.001	EUR 17,430	962.885,49	0,36	
DE0005785802	Fresenius Medical Care KGaA		STK	53.622	25.121	14.072	EUR 43,770	2.347.034,94	0,89	
DE0005785604	Fresenius SE & Co. KGaA		STK	111.689	52.080	29.189	EUR 25,370	2.833.549,93	1,07	
DE0006602006	GEA Group AG		STK	39.283	18.271	11.248	EUR 38,310	1.504.931,73	0,57	
DE0008402215	Hannover Rück SE		STK	16.175	7.545	4.230	EUR 194,350	3.143.611,25	1,19	
DE0006047004	HeidelbergCement AG		STK	37.114	17.126	10.351	EUR 75,200	2.790.972,80	1,06	
DE0006048432	Henkel AG & Co. KGaA		STK	43.869	19.890	12.410	EUR 73,260	3.213.842,94	1,21	
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG		STK	15.663	7.150	3.936	EUR 71,540	1.120.531,02	0,42	
DE0006231004	Infineon Technologies AG		STK	350.864	162.600	90.608	EUR 37,785	13.257.396,24	5,01	
DE000KGX8881	KION GROUP AG		STK	18.876	8.351	4.842	EUR 36,860	695.769,36	0,26	
DE000KBX1006	Knorr-Bremse AG		STK	17.811	8.241	4.591	EUR 69,980	1.246.413,78	0,47	
DE0005470405	LANXESS AG		STK	20.851	9.750	6.411	EUR 27,600	575.487,60	0,22	
DE000LEG1110	LEG Immobilien SE		STK	19.967	9.512	5.148	EUR 52,640	1.051.062,88	0,40	
DE0007100000	Mercedes-Benz Group AG		STK	213.155	109.558	64.841	EUR 73,670	15.703.128,85	5,94	
DE0006599905	Merck KGaA		STK	34.821	16.046	8.910	EUR 151,550	5.277.122,55	1,99	
DE0008430026	Münchener Rückvers.-Ges. AG		STK	36.768	16.896	10.138	EUR 343,600	12.633.484,80	4,78	
DE000PAH0038	Porsche Automobil Holding SE		STK	43.257	21.082	10.626	EUR 55,160	2.386.056,12	0,90	
DE0006969603	PUMA SE		STK	27.141	12.645	7.050	EUR 55,120	1.496.011,92	0,57	
DE0007164600	SAP SE		STK	148.703	80.074	86.654	EUR 125,140	18.608.693,42	7,03	
DE0007165631	Sartorius AG		STK	6.628	3.045	1.687	EUR 317,100	2.101.738,80	0,79	
DE000A12DM80	Scout24 AG		STK	20.120	10.001	5.702	EUR 58,080	1.168.569,60	0,44	
DE0007236101	Siemens AG		STK	115.771	64.410	82.043	EUR 152,540	17.659.708,34	6,68	
DE000ENER6Y0	Siemens Energy AG		STK	144.762	78.272	32.070	EUR 16,180	2.342.249,16	0,89	
DE000SHL1006	Siemens Healthineers AG		STK	74.914	35.240	19.887	EUR 51,860	3.885.040,04	1,47	
DE000SYM9999	Symrise AG		STK	33.881	15.684	10.240	EUR 96,020	3.253.253,62	1,23	
DE000TLX1005	Talanx AG		STK	14.430	16.938	2.508	EUR 52,550	758.296,50	0,29	
DE000A1J5RX9	Telefónica Deutschland Hldg AG		STK	235.618	235.618	0	EUR 2,577	607.187,59	0,23	
DE0007500001	thyssenkrupp AG		STK	132.621	61.137	33.957	EUR 7,168	950.627,33	0,36	
DE0007664039	Volkswagen AG		STK	55.557	72.610	17.053	EUR 122,940	6.830.177,58	2,58	
DE000A1ML7J1	Vonovia SE		STK	183.117	88.903	59.437	EUR 17,895	3.276.878,72	1,24	
DE000ZAL1111	Zalando SE		STK	62.935	29.242	15.774	EUR 26,360	1.658.966,60	0,63	
								<b>261.998.881,30</b>	<b>99,04</b>	
<b>Ausland</b>										
NL0012169213	Qiagen N.V.		STK	61.439	61.439	0	EUR 41,140	2.527.600,46	0,96	
								EUR	2.527.600,46	0,96
								<b>EUR</b>	<b>264.526.481,76</b>	<b>100,00</b>
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>										
<b>Bankguthaben, nicht verbriefte Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds</b>										
								<b>EUR</b>	<b>232.351,43</b>	<b>0,09</b>
EUR-Guthaben bei:										
Verwahrstelle										
			EUR	227.375,50			% 100,000	227.375,50	0,09	
<b>Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen</b>										
Verwahrstelle										
			USD	5.428,74			% 100,000	4.975,93	0,00	
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>										
Forderungen aus Anteilzeichnungen										
			EUR	3.147.794,35			<b>EUR</b>	<b>3.178.688,23</b>	<b>1,20</b>	
Dividendenforderungen										
			EUR	30.893,88				30.893,88	0,01	
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>										
Verbindlichkeiten aus Wertpapiergeschäften										
			EUR	-3.306.471,51			<b>EUR</b>	<b>-3.411.795,64</b>	<b>-1,29</b>	
Verbindlichkeiten Verwaltungsvergütung										
			EUR	-105.324,13				-105.324,13	-0,04	
<b>Wert des Teilsondersvermögens</b>								<b>EUR</b>	<b>264.525.725,78</b>	<b>100,00<sup>1)</sup></b>
<b>Anteilwert</b>								<b>EUR</b>	<b>37,09</b>	
<b>Umlaufende Anteile</b>								<b>STK</b>	<b>7.132.690</b>	

Fußnoten:

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

**Wertpapierkurse bzw. Marktsätze**

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

Alle Vermögenswerte: Kurse per 30.06.2023

**Devisenkurse (in Mengennotiz) 30.06.2023**

US-Dollar (USD) 1,08885 = 1 EUR

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

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

ISIN	Gattungsbezeichnung	Stück bzw. Anteile bzw. Whg. in 1.000	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
<b>Inland</b>					
DE0008232125	Deutsche Lufthansa AG	STK	130.549	324.736	
DE000A0Z2Z25	freenet AG	STK	5.422	30.881	
DE000KSAG888	K+S Aktiengesellschaft	STK	18.203	59.202	
DE0008303504	TAG Immobilien AG	STK	18.584	49.965	
DE000A31C3C0	TAG Immobilien AG - Anrechte	STK	31.311	31.311	
DE000A2GSYQ9	Vonovia SE - Anrechte	STK	204.550	204.550	
<b>Ausland</b>					
LU1673108939	Aroundtown SA	STK	91.498	302.929	
LU2489901806	Aroundtown SA - Anrechte	STK	0	211.431	
IE00BZ12WP82	Linde PLC	STK	16.456	66.732	

**Ertrags- und Aufwandsrechnung inklusive Ertragsausgleich**  
für den Zeitraum vom 01.07.2022 bis zum 30.06.2023

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Erträge</b>			
1. Dividenden inländischer Aussteller (vor Körperschaftsteuer)		10.268.659,32	1,440
2. Dividenden ausländischer Aussteller (vor Quellensteuer)		125.485,15	0,018
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland		6.807,77	0,001
4. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Ausland (vor Quellensteuer)		93,78	0,000
davon: Zinsen auf erstattete Quellensteuern	93,78		0,000
5. Abzug inländischer Körperschaftsteuer		-1.409.647,91	-0,198
6. Sonstige Erträge		1.213,31	0,000
<b>Summe der Erträge</b>		<b>8.992.611,42</b>	<b>1,261</b>
<b>II. Aufwendungen</b>			
1. Verwaltungsvergütung		-360.338,77	-0,051
2. Sonstige Aufwendungen		-195,56	0,000
davon: Bankgebühren	-195,56		0,000
<b>Summe der Aufwendungen</b>		<b>-360.534,33</b>	<b>-0,051</b>
<b>III. Ordentlicher Nettoertrag</b>		<b>8.632.077,09</b>	<b>1,210</b>
<b>IV. Veräußerungsgeschäfte</b>			
1. Realisierte Gewinne		8.139.557,68	1,141
2. Realisierte Verluste		-11.544.988,33	-1,619
<b>Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften</b>		<b>-3.405.430,65</b>	<b>-0,477</b>
<b>V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>5.226.646,44</b>	<b>0,733</b>
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne		15.240.623,75	2,137
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste		26.250.278,63	3,680
<b>VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>41.490.902,38</b>	<b>5,817</b>
<b>VII. Ergebnis des Geschäftsjahres</b>		<b>46.717.548,82</b>	<b>6,550</b>

**Entwicklung des Teilsongervermögens**

	2022 / 2023
	EUR
<b>I. Wert des Teilsongervermögens am Beginn des Geschäftsjahres</b>	<b>191.978.900,37</b>
1. Ausschüttung/Steuerabschlag für das Vorjahr	-5.765.349,00
2. Mittelzufluss (netto)	30.059.465,57
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	87.191.916,35
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-57.132.450,78
3. Ertragsausgleich/Aufwandsausgleich	1.535.160,02
4. Ergebnis des Geschäftsjahres	46.717.548,82
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Gewinne	15.240.623,75
davon: Nettoveränderung der nicht realisierte Verluste	26.250.278,63
<b>II. Wert des Teilsongervermögens am Ende des Geschäftsjahres</b>	<b>264.525.725,78</b>

**Verwendung der Erträge des Teilsongervermögens**

	insgesamt EUR	insgesamt EUR	je Anteil <sup>1)</sup> EUR
<b>I. Für die Ausschüttung verfügbar</b>		<b>42.990.497,45</b>	<b>6,027</b>
1. Vortrag aus dem Vorjahr		37.763.851,01	5,294
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres		5.226.646,44	0,733
<b>II. Nicht für die Ausschüttung verwendet</b>		<b>33.076.058,35</b>	<b>4,637</b>
1. Der Wiederanlage zugeführt		0,00	0,000
2. Vortrag auf neue Rechnung		33.076.058,35	4,637
<b>III. Gesamtausschüttung</b>		<b>9.914.439,10</b>	<b>1,390</b>
1. Endausschüttung		9.914.439,10	1,390

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

**Vergleichende Übersicht über die letzten drei Geschäftsjahre**

Geschäftsjahr	Teilsongervermög am Ende des Geschäftsjahres EUR	Anteilwert EUR
2022/2023	264.525.725,78	37,09
2021/2022	191.978.900,37	31,37
2020/2021	194.073.479,88	39,29
2020	3.726.906,74	30,93

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

## Anhang gem. § 7 Nr. 9 KARBV

### Angaben nach der Derivateverordnung

Im Geschäftsjahr sind keine Derivategeschäfte abgeschlossen worden.

### Sonstige Angaben

**Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF)**  
**International Security Identification Number (ISIN)**

		<b>DE000ETF9090</b>
<b>Anteilwert</b>	<b>EUR</b>	<b>37,09</b>
<b>Umlaufende Anteile</b>	<b>STK</b>	<b>7.132.690</b>
Anleger		Private Anleger
Aktueller Ausgabeaufschlag	%	5,00
Aktueller Rücknahmeabschlag	%	5,00
Mindeststückelung	Anteil	1,00
Verwaltungsvergütung p. a.	%	0,15
Ertragsverwendung		ausschüttend
<b>Bestand der Wertpapiere am Teilsondervermögen (in %)</b>		<b>100,00</b>
<b>Bestand der Derivate am Teilsondervermögen (in %)</b>		<b>0,00</b>

### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung der Vermögensgegenstände erfolgte während des Geschäftsjahres sowie zum Berichtsstichtag per 30.06.2023 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 30.06.2023 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 bezahlter CSDR-Gebühren

EUR 1.244,24

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

Negative Einlagenzinsen EUR 174,55

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

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

0,15

#### 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 vor Ertragsausgleich

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

	<b>EUR</b>	<b>362.075,46</b>
Davon für die Kapitalverwaltungsgesellschaft	%	37,33
Davon für die Verwahrstelle	%	36,29
Davon für Dritte	%	26,38

#### Transaktionskosten

EUR 17.533,43

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)	0,25%
Höhe der Annual Tracking Difference	-0,94%

Der im Geschäftsjahr 2022/2023 realisierte Tracking Error liegt innerhalb der Bandbreite des prognostizierten Tracking Error. Der prognostizierte Tracking Error wurde abgeleitet aus dem in den vergangenen Geschäftsjahren im Durchschnitt realisierten Tracking Error unter Berücksichtigung einer Bandbreite von +/- 50% um den Mittelwert. Die Bandbreite beträgt maximal 40 Basispunkte.

#### 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.

**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 (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) 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, 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



X

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 \_\_\_\_\_ an nachhaltigen Investitionen **69,01 %**



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 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.

### ● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

	<b>Sustainalytics ESG Punktzahl</b>	<b>Sustainalytics Daten Abdeckung</b>
<b>DAX 50 ESG</b>	<b>77,23</b>	<b>100%</b>

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

Nachhaltigkeitsindikatoren wurden nicht mit früheren Zeiträumen verglichen, da die Vorgaben der Offenlegungsverordnung im vorangegangenen Berichtszeitraum noch nicht in Kraft war

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

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

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

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

Die Definition des Begriffs "Best Performer" basiert auf der Amundi Group eigenen ESG-Methode, die darauf abzielt, die ESG-Leistung eines Unternehmens, in das investiert wird, zu messen. Um als "Best Performer" eingestuft zu werden, muss ein Unternehmen, in das investiert wird, innerhalb seines Sektors bei mindestens einem wesentlichen Umwelt- oder Sozialfaktor die drei besten Bewertungen (A, B oder C auf einer Bewertungsskala von A bis G) erzielen. Wesentliche Umwelt- und Sozialfaktoren werden auf Branchenebene ermittelt. Die Identifizierung der wesentlichen Faktoren

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

basiert auf dem Amundi Group ESG-Analyseverfahren, das außerfinanzielle Daten und eine qualitative Analyse der damit verbundenen Branchen- und Nachhaltigkeitsthemen kombiniert. Faktoren, die als wesentlich identifiziert werden, leisten einen Beitrag von mehr als 10 % zum gesamten ESG-Score. Für den Energiesektor beispielsweise sind folgende Faktoren wesentlich: Emissionen und Energie, biologische Vielfalt und Umweltverschmutzung, Gesundheit und Sicherheit, lokale Gemeinschaften und Menschenrechte. Einen vollständigen Überblick über die Sektoren und Faktoren finden Sie in der Erklärung zur Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken von Amundi Group, die unter [www.amundi.lu](http://www.amundi.lu) verfügbar ist.

Um zu den oben genannten Zielen beizutragen, sollte das Unternehmen, in das investiert wird, nicht in nennenswertem Umfang an Aktivitäten beteiligt sein (z. B. Tabak, Waffen, Glücksspiel, Kohle, Luftfahrt, Fleischproduktion, Herstellung von Düngemitteln und Pestiziden, Produktion von Einwegplastik), die nicht mit diesen Kriterien vereinbar sind.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Der erste DNSH-Filter stützt sich auf die Überwachung der obligatorischen Hauptindikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen in Anhang 1, Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1288, wenn durch die Kombination der folgenden Indikatoren und



spezifischer Schwellenwerte oder Regeln zuverlässige Daten verfügbar sind und die die Überwachung der folgenden PAIs umfassen:

- eine 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 (Principal Adverse Impacts). Diese Ausschlüsse, die zusätzlich zu den oben genannten Tests gelten, decken die folgenden Themen ab: Ausschluss von kontroversen Waffen, Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact, Kohle und Tabak.

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

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

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

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

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



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

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

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

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



### **Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?**

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: **Von 01.07.2022 bis 30.06.2023**

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ALLIANZ SE-REG	Finanzwesen	7,09 %	DEU
SAP SE / XETRA	IT	7,03 %	DEU
DEUTSCHE TELEKOM NAM (XETRA)	Kommunikationsdienste	7,03 %	DEU
SIEMENS AG-REG	Industrie	6,68 %	DEU
MERCEDES-BENZ GROUP AG	Zyklische Konsumgüter	5,94 %	DEU
BAYER AG	Gesundheit	5,07 %	DEU
INFINEON TECH. AG	IT	5,01 %	DEU
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	Finanzwesen	4,78 %	DEU
DEUTSCHE POST AG-REG (XETRA)	Industrie	4,27 %	DEU
BASF SE XETRA	Grundstoffe	4,04 %	DEU
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	Zyklische Konsumgüter	3,43 %	DEU
DEUTSCHE BOERSE AG	Finanzwesen	3,16 %	DEU
ADIDAS AG	Zyklische Konsumgüter	2,98 %	DEU
VOLKSWAGEN AG-PFD	Zyklische Konsumgüter	2,58 %	DEU
DEUTSCHE BANK NAMENSAKTEIN	Finanzwesen	2,00 %	DEU

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



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

### Wie sah die Vermögensallokation aus?

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



**#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.

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

<b>Sektor</b>	<b>In % der Vermögenswerte</b>
<i>Finanzwesen</i>	19,60 %
<i>Zyklische Konsumgüter</i>	19,54 %
<i>Industrie</i>	16,02 %
<i>Gesundheit</i>	12,61 %
<i>IT</i>	12,05 %
<i>Grundstoffe</i>	8,43 %
<i>Kommunikationsdienste</i>	7,70 %
<i>Nicht-zyklische Konsumgüter</i>	2,42 %
<i>Immobilien</i>	1,64 %

Liquide Mittel	-0,00%
----------------	--------

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 1,10% in nachhaltige Investitionen investiert, die der EU-Taxonomie entsprechen. Diese Investitionen trugen zu den Zielen der EU-Taxonomie im Hinblick auf die Verpflichtung zum Klimaschutz oder Klimaschutzmaßnahmen bei.

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

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

Ja:

In fossiles Gas

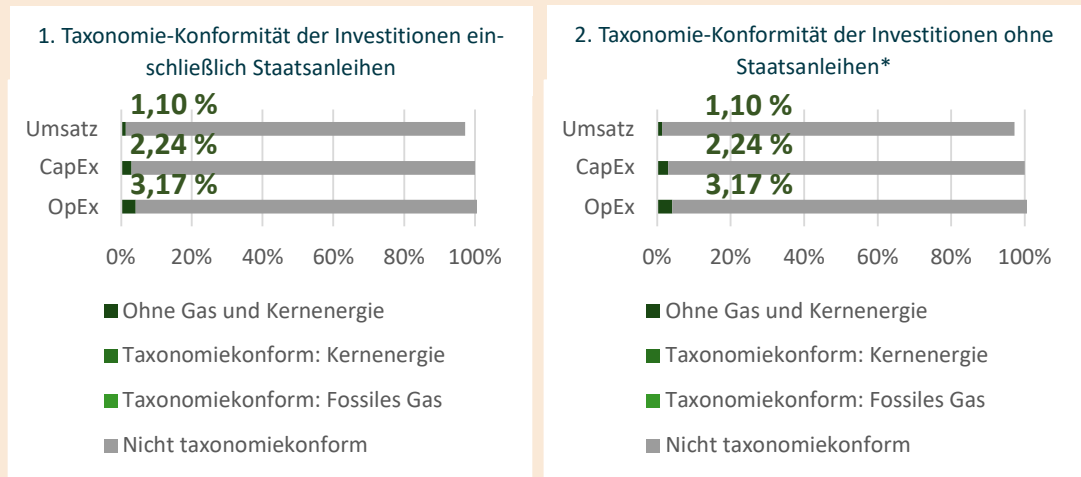
In Kernenergie

Nein

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

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

**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 Risikostaaen

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

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

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



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



### 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 **57,67 %**. \* Ein Teil dieser Investitionen trägt auch zu einem Umweltziel bei.

Der Anteil von 57,67 % 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 **58,42%**. \*\* Ein Teil dieser Investitionen trägt auch zu einem Umweltziel bei.



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

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



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

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

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

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

Der DAX<sup>®</sup> 50 ESG ist ein Aktienindex, der auf dem HDAX<sup>®</sup> basiert, der alle Unternehmen umfasst, die im DAX<sup>®</sup>, MDAX<sup>®</sup> und TecDAX<sup>®</sup> enthalten sind. Der DAX<sup>®</sup> 50 ESG wählt aus dem Anlageuniversum des HDAX<sup>®</sup> 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.

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
<b>DAX 50 ESG</b>	77,23	100%
<b>HDAX Index</b>	75,89	100%

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

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

	Sustainalytics ESG Punktzahl	Sustainalytics Daten Abdeckung
<b>DAX 50 ESG</b>	77,23	100,00%

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

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

	1 Jahr
	30/06/2023
<b>Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF)</b>	21,89%
<b>DAX 50 ESG</b>	22,83%
<b>Spread</b>	-0,94%

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



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

	1 Jahr
	30/06/2023
<b>Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF)</b>	21,89%
<b>HDAX Index</b>	24,11%
<b>Spread</b>	-2.22%

#### 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 2022 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 2022 geltende Vergütungspolitik wurde vom Verwaltungsrat von Amundi Luxembourg am 22. Juni 2022 genehmigt.

Der Vergütungsausschuss der Amundi-Gruppe prüft jährlich die Vergütungsrichtlinie der Gruppe. Die Überprüfung für das Jahr 2022 fand am 01. Februar 2022 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 31.12.2022 die Verwaltungsgesellschaft oder der Verwalter alternativer Anlagefonds verschiedener übergreifender OGAW und alternativer Anlagefonds. Amundi Luxembourg S.A. wurde am 01.07.2022 zur Verwaltungsgesellschaft des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1) ernannt.

Amundi Luxembourg S.A. zahlte seinen Mitarbeitern im Laufe des Kalenderjahrs 2022 folgende Gesamtvergütung in Euro:

	Zahl der Begünstigten	Festvergütung	Variable Vergütung	Total
Mitarbeiter	97	8.867.445	1.732.476	10.599.921
Davon				
- Ermittelte Mitarbeiter	12	1.976.045	695.120	2.671.164
- Alle sonstigen Mitarbeiter	85	6.891.400	1.037.357	7.928.757

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 DER AUSLAGERUNGSUNTERNEHMEN

Vom 1. Juli 2022 bis 5. Dezember 2022: Amundi Deutschland GmbH war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter (147), betrug EUR 542.035 wovon EUR 311.838 auf die feste und EUR 230.198 auf die variable Vergütung entfielen. Die auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1), entfallende anteilige Gesamtvergütung der Geschäftsführer (6) betrug EUR 55.233; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil der Gesamtvergütung der Führungskräfte (6) betrug EUR 19.301; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor. Der auf die Verwaltung dieses Fonds entfallende Anteil an der Gesamtvergütung der Mitarbeiter mit Kontrollfunktion (3) betrug EUR 8.214; Einzelheiten zur Aufteilung zwischen variabler und fester Vergütung im Jahr 2022 liegt uns nicht vor.

Vom 6. Dezember 2022 bis 30. Juni 2023: Amundi Asset Management war der Investmentmanager des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1).

Der Anteil der aus der Verwaltung dieses Fonds resultierenden Gesamtbezüge der identifizierten Mitarbeiter betrug 22.233 EUR, davon 9.493 EUR in der festen Vergütung und 12.740 EUR in der variablen Vergütung. Der auf die Verwaltung des OGAW Amundi (vormals: Lyxor 1), entfallende Anteil der Gesamtbezüge der Mitarbeiter belief sich auf 125.090 EUR, davon 83.215 EUR in der festen Vergütung und 41.875 EUR in der variablen Vergütung. Im Jahr 2022 beschäftigte Amundi Asset Management insgesamt 1.673 Mitarbeiter von denen 81 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 14. November 2023



Amundi Luxembourg S.A

# Amundi (vormals: Lyxor 1)

## Vermerk des unabhängigen Abschlussprüfers

An die Amundi Luxembourg S.A.

### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresberichte der Teilsondervermögen Amundi MDAX ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 MDAX ESG UCITS ETF), Amundi DivDAX II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DivDax (DR) UCITS ETF), Amundi TecDAX UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 TecDAX (DR) UCITS ETF), Amundi STOXX Europe 600 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 STOXX Europe 600 ESG (DR) UCITS ETF) und Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Amundi DAX 50 ESG II UCITS ETF (vormals: Lyxor 1 DAX 50 ESG (DR) UCITS ETF) ) der Umbrella-Konstruktion Amundi (vormals: Lyxor 1) – bestehend aus dem zusammengefassten Tätigkeitsbericht für die Teilsondervermögen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023, den Vermögensübersichten und den Vermögensaufstellungen zum 30. Juni 2023, den Ertrags- und Aufwandsrechnungen, den Verwendungsrechnungen, den Entwicklungsrechnungen für das Geschäftsjahr vom 1. Juli 2022 bis zum 30. Juni 2023, 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.

### 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 Investmentvermögen 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 Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung feststellen."

**Eschborn/Frankfurt am Main, 14. November 2023**

**Ernst & Young GmbH**  
**Wirtschaftsprüfungsgesellschaft**

**Heist**  
**Wirtschaftsprüfer**

**Lattwein**  
**Wirtschaftsprüfer**



## Auftragsbedingungen, Haftung und Verwendungsvorbehalt

Wir, die Ernst & Young GmbH Wirtschaftsprüfungsgesellschaft, haben unsere Prüfung der vorliegenden Rechnungslegung im Auftrag der Gesellschaft vorgenommen. Neben der gesetzlichen Funktion der Offenlegung in den Fällen gesetzlicher Abschlussprüfungen richtet sich der Vermerk ausschließlich an die Gesellschaft und wurde zu deren interner Verwendung erteilt, ohne dass er weiteren Zwecken Dritter oder diesen als Entscheidungsgrundlage dienen soll. Das in dem Vermerk zusammengefasste Ergebnis von freiwilligen Abschlussprüfungen ist somit nicht dazu bestimmt, Grundlage von Entscheidungen Dritter zu sein, und nicht für andere als bestimmungsgemäße Zwecke zu verwenden.

Unserer Tätigkeit, über die wir vorliegend berichten, liegt unser Auftragsbestätigungsschreiben einschließlich der "Allgemeinen Auftragsbedingungen für Wirtschaftsprüfer und Wirtschaftsprüfungsgesellschaften" in der vom Institut der Wirtschaftsprüfer herausgegebenen Fassung vom 1. Januar 2017 zugrunde.

Klarstellend weisen wir darauf hin, dass wir Dritten gegenüber keine Verantwortung, Haftung oder anderweitige Pflichten übernehmen, es sei denn, dass wir mit dem Dritten eine anders lautende schriftliche Vereinbarung geschlossen hätten oder ein solcher Haftungsausschluss unwirksam wäre.

Wir weisen ausdrücklich darauf hin, dass wir keine Aktualisierung des Vermerks hinsichtlich nach seiner Erteilung eintretender Ereignisse oder Umstände vornehmen, sofern hierzu keine rechtliche Verpflichtung besteht.

Wer auch immer das in vorstehendem Vermerk zusammengefasste Ergebnis unserer Tätigkeit zur Kenntnis nimmt, hat eigenverantwortlich zu entscheiden, ob und in welcher Form er dieses Ergebnis für seine Zwecke nützlich und tauglich erachtet und durch eigene Untersuchungshandlungen erweitert, verifiziert oder aktualisiert.

# Allgemeine Auftragsbedingungen

## für

### Wirtschaftsprüfer und Wirtschaftsprüfungsgesellschaften

vom 1. Januar 2017

#### 1. Geltungsbereich

(1) Die Auftragsbedingungen gelten für Verträge zwischen Wirtschaftsprüfern oder Wirtschaftsprüfungsgesellschaften (im Nachstehenden zusammenfassend „Wirtschaftsprüfer“ genannt) und ihren Auftraggebern über Prüfungen, Steuerberatung, Beratungen in wirtschaftlichen Angelegenheiten und sonstige Aufträge, soweit nicht etwas anderes ausdrücklich schriftlich vereinbart oder gesetzlich zwingend vorgeschrieben ist.

(2) Dritte können nur dann Ansprüche aus dem Vertrag zwischen Wirtschaftsprüfer und Auftraggeber herleiten, wenn dies ausdrücklich vereinbart ist oder sich aus zwingenden gesetzlichen Regelungen ergibt. Im Hinblick auf solche Ansprüche gelten diese Auftragsbedingungen auch diesen Dritten gegenüber.

#### 2. Umfang und Ausführung des Auftrags

(1) Gegenstand des Auftrags ist die vereinbarte Leistung, nicht ein bestimmter wirtschaftlicher Erfolg. Der Auftrag wird nach den Grundsätzen ordnungsmäßiger Berufsausübung ausgeführt. Der Wirtschaftsprüfer übernimmt im Zusammenhang mit seinen Leistungen keine Aufgaben der Geschäftsführung. Der Wirtschaftsprüfer ist für die Nutzung oder Umsetzung der Ergebnisse seiner Leistungen nicht verantwortlich. Der Wirtschaftsprüfer ist berechtigt, sich zur Durchführung des Auftrags sachverständiger Personen zu bedienen.

(2) Die Berücksichtigung ausländischen Rechts bedarf – außer bei betriebswirtschaftlichen Prüfungen – der ausdrücklichen schriftlichen Vereinbarung.

(3) Ändert sich die Sach- oder Rechtslage nach Abgabe der abschließenden beruflichen Äußerung, so ist der Wirtschaftsprüfer nicht verpflichtet, den Auftraggeber auf Änderungen oder sich daraus ergebende Folgerungen hinzuweisen.

#### 3. Mitwirkungspflichten des Auftraggebers

(1) Der Auftraggeber hat dafür zu sorgen, dass dem Wirtschaftsprüfer alle für die Ausführung des Auftrags notwendigen Unterlagen und weiteren Informationen rechtzeitig übermittelt werden und ihm von allen Vorgängen und Umständen Kenntnis gegeben wird, die für die Ausführung des Auftrags von Bedeutung sein können. Dies gilt auch für die Unterlagen und weiteren Informationen, Vorgänge und Umstände, die erst während der Tätigkeit des Wirtschaftsprüfers bekannt werden. Der Auftraggeber wird dem Wirtschaftsprüfer geeignete Auskunftspersonen benennen.

(2) Auf Verlangen des Wirtschaftsprüfers hat der Auftraggeber die Vollständigkeit der vorgelegten Unterlagen und der weiteren Informationen sowie der gegebenen Auskünfte und Erklärungen in einer vom Wirtschaftsprüfer formulierten schriftlichen Erklärung zu bestätigen.

#### 4. Sicherung der Unabhängigkeit

(1) Der Auftraggeber hat alles zu unterlassen, was die Unabhängigkeit der Mitarbeiter des Wirtschaftsprüfers gefährdet. Dies gilt für die Dauer des Auftragsverhältnisses insbesondere für Angebote auf Anstellung oder Übernahme von Organfunktionen und für Angebote, Aufträge auf eigene Rechnung zu übernehmen.

(2) Sollte die Durchführung des Auftrags die Unabhängigkeit des Wirtschaftsprüfers, die der mit ihm verbundenen Unternehmen, seiner Netzwerkunternehmen oder solcher mit ihm assoziierten Unternehmen, auf die die Unabhängigkeitsvorschriften in gleicher Weise Anwendung finden wie auf den Wirtschaftsprüfer, in anderen Auftragsverhältnissen beeinträchtigen, ist der Wirtschaftsprüfer zur außerordentlichen Kündigung des Auftrags berechtigt.

#### 5. Berichterstattung und mündliche Auskünfte

Soweit der Wirtschaftsprüfer Ergebnisse im Rahmen der Bearbeitung des Auftrags schriftlich darzustellen hat, ist alleine diese schriftliche Darstellung maßgebend. Entwürfe schriftlicher Darstellungen sind unverbindlich. Sofern nicht anders vereinbart, sind mündliche Erklärungen und Auskünfte des Wirtschaftsprüfers nur dann verbindlich, wenn sie schriftlich bestätigt werden. Erklärungen und Auskünfte des Wirtschaftsprüfers außerhalb des erteilten Auftrags sind stets unverbindlich.

#### 6. Weitergabe einer beruflichen Äußerung des Wirtschaftsprüfers

(1) Die Weitergabe beruflicher Äußerungen des Wirtschaftsprüfers (Arbeitsergebnisse oder Auszüge von Arbeitsergebnissen – sei es im Entwurf oder in der Endfassung) oder die Information über das Tätigwerden des Wirtschaftsprüfers für den Auftraggeber an einen Dritten bedarf der schriftlichen Zustimmung des Wirtschaftsprüfers, es sei denn, der Auftraggeber ist zur Weitergabe oder Information aufgrund eines Gesetzes oder einer behördlichen Anordnung verpflichtet.

(2) Die Verwendung beruflicher Äußerungen des Wirtschaftsprüfers und die Information über das Tätigwerden des Wirtschaftsprüfers für den Auftraggeber zu Werbezwecken durch den Auftraggeber sind unzulässig.

#### 7. Mängelbeseitigung

(1) Bei etwaigen Mängeln hat der Auftraggeber Anspruch auf Nacherfüllung durch den Wirtschaftsprüfer. Nur bei Fehlschlagen, Unterlassen bzw. unberechtigter Verweigerung, Unzumutbarkeit oder Unmöglichkeit der Nacherfüllung kann er die Vergütung mindern oder vom Vertrag zurücktreten; ist der Auftrag nicht von einem Verbraucher erteilt worden, so kann der Auftraggeber wegen eines Mangels nur dann vom Vertrag zurücktreten, wenn die erbrachte Leistung wegen Fehlschlagens, Unterlassung, Unzumutbarkeit oder Unmöglichkeit der Nacherfüllung für ihn ohne Interesse ist. Soweit darüber hinaus Schadensersatzansprüche bestehen, gilt Nr. 9.

(2) Der Anspruch auf Beseitigung von Mängeln muss vom Auftraggeber unverzüglich in Textform geltend gemacht werden. Ansprüche nach Abs. 1, die nicht auf einer vorsätzlichen Handlung beruhen, verjähren nach Ablauf eines Jahres ab dem gesetzlichen Verjährungsbeginn.

(3) Offenbare Unrichtigkeiten, wie z.B. Schreibfehler, Rechenfehler und formelle Mängel, die in einer beruflichen Äußerung (Bericht, Gutachten und dgl.) des Wirtschaftsprüfers enthalten sind, können jederzeit vom Wirtschaftsprüfer auch Dritten gegenüber berichtigt werden. Unrichtigkeiten, die geeignet sind, in der beruflichen Äußerung des Wirtschaftsprüfers enthaltene Ergebnisse infrage zu stellen, berechtigen diesen, die Äußerung auch Dritten gegenüber zurückzunehmen. In den vorgenannten Fällen ist der Auftraggeber vom Wirtschaftsprüfer tunlichst vorher zu hören.

#### 8. Schweigepflicht gegenüber Dritten, Datenschutz

(1) Der Wirtschaftsprüfer ist nach Maßgabe der Gesetze (§ 323 Abs. 1 HGB, § 43 WPO, § 203 StGB) verpflichtet, über Tatsachen und Umstände, die ihm bei seiner Berufstätigkeit anvertraut oder bekannt werden, Stillschweigen zu bewahren, es sei denn, dass der Auftraggeber ihn von dieser Schweigepflicht entbindet.

(2) Der Wirtschaftsprüfer wird bei der Verarbeitung von personenbezogenen Daten die nationalen und europarechtlichen Regelungen zum Datenschutz beachten.

#### 9. Haftung

(1) Für gesetzlich vorgeschriebene Leistungen des Wirtschaftsprüfers, insbesondere Prüfungen, gelten die jeweils anzuwendenden gesetzlichen Haftungsbeschränkungen, insbesondere die Haftungsbeschränkung des § 323 Abs. 2 HGB.

(2) Sofern weder eine gesetzliche Haftungsbeschränkung Anwendung findet noch eine einzelvertragliche Haftungsbeschränkung besteht, ist die Haftung des Wirtschaftsprüfers für Schadensersatzansprüche jeder Art, mit Ausnahme von Schäden aus der Verletzung von Leben, Körper und Gesundheit, sowie von Schäden, die eine Ersatzpflicht des Herstellers nach § 1 ProdHaftG begründen, bei einem fahrlässig verursachten einzelnen Schadensfall gemäß § 54a Abs. 1 Nr. 2 WPO auf 4 Mio. € beschränkt.

(3) Einreden und Einwendungen aus dem Vertragsverhältnis mit dem Auftraggeber stehen dem Wirtschaftsprüfer auch gegenüber Dritten zu.

(4) Leiten mehrere Anspruchsteller aus dem mit dem Wirtschaftsprüfer bestehenden Vertragsverhältnis Ansprüche aus einer fahrlässigen Pflichtverletzung des Wirtschaftsprüfers her, gilt der in Abs. 2 genannte Höchstbetrag für die betreffenden Ansprüche aller Anspruchsteller insgesamt.

(5) Ein einzelner Schadensfall im Sinne von Abs. 2 ist auch bezüglich eines aus mehreren Pflichtverletzungen stammenden einheitlichen Schadens gegeben. Der einzelne Schadensfall umfasst sämtliche Folgen einer Pflichtverletzung ohne Rücksicht darauf, ob Schäden in einem oder in mehreren aufeinanderfolgenden Jahren entstanden sind. Dabei gilt mehrfaches auf gleicher oder gleichartiger Fehlerquelle beruhendes Tun oder Unterlassen als einheitliche Pflichtverletzung, wenn die betreffenden Angelegenheiten miteinander in rechtlichem oder wirtschaftlichem Zusammenhang stehen. In diesem Fall kann der Wirtschaftsprüfer nur bis zur Höhe von 5 Mio. € in Anspruch genommen werden. Die Begrenzung auf das Fünffache der Mindestversicherungssumme gilt nicht bei gesetzlich vorgeschriebenen Pflichtprüfungen.

(6) Ein Schadensersatzanspruch erlischt, wenn nicht innerhalb von sechs Monaten nach der schriftlichen Ablehnung der Ersatzleistung Klage erhoben wird und der Auftraggeber auf diese Folge hingewiesen wurde. Dies gilt nicht für Schadensersatzansprüche, die auf vorsätzliches Verhalten zurückzuführen sind, sowie bei einer schuldhaften Verletzung von Leben, Körper oder Gesundheit sowie bei Schäden, die eine Ersatzpflicht des Herstellers nach § 1 ProdHaftG begründen. Das Recht, die Einrede der Verjährung geltend zu machen, bleibt unberührt.

## 10. Ergänzende Bestimmungen für Prüfungsaufträge

(1) Ändert der Auftraggeber nachträglich den durch den Wirtschaftsprüfer geprüften und mit einem Bestätigungsvermerk versehenen Abschluss oder Lagebericht, darf er diesen Bestätigungsvermerk nicht weiterverwenden.

Hat der Wirtschaftsprüfer einen Bestätigungsvermerk nicht erteilt, so ist ein Hinweis auf die durch den Wirtschaftsprüfer durchgeführte Prüfung im Lagebericht oder an anderer für die Öffentlichkeit bestimmter Stelle nur mit schriftlicher Einwilligung des Wirtschaftsprüfers und mit dem von ihm genehmigten Wortlaut zulässig.

(2) Widerruft der Wirtschaftsprüfer den Bestätigungsvermerk, so darf der Bestätigungsvermerk nicht weiterverwendet werden. Hat der Auftraggeber den Bestätigungsvermerk bereits verwendet, so hat er auf Verlangen des Wirtschaftsprüfers den Widerruf bekanntzugeben.

(3) Der Auftraggeber hat Anspruch auf fünf Berichtsausfertigungen. Weitere Ausfertigungen werden besonders in Rechnung gestellt.

## 11. Ergänzende Bestimmungen für Hilfeleistung in Steuersachen

(1) Der Wirtschaftsprüfer ist berechtigt, sowohl bei der Beratung in steuerlichen Einzelfragen als auch im Falle der Dauerberatung die vom Auftraggeber genannten Tatsachen, insbesondere Zahlenangaben, als richtig und vollständig zugrunde zu legen; dies gilt auch für Buchführungsaufträge. Er hat jedoch den Auftraggeber auf von ihm festgestellte Unrichtigkeiten hinzuweisen.

(2) Der Steuerberatungsauftrag umfasst nicht die zur Wahrung von Fristen erforderlichen Handlungen, es sei denn, dass der Wirtschaftsprüfer hierzu ausdrücklich den Auftrag übernommen hat. In diesem Fall hat der Auftraggeber dem Wirtschaftsprüfer alle für die Wahrung von Fristen wesentlichen Unterlagen, insbesondere Steuerbescheide, so rechtzeitig vorzulegen, dass dem Wirtschaftsprüfer eine angemessene Bearbeitungszeit zur Verfügung steht.

(3) Mangels einer anderweitigen schriftlichen Vereinbarung umfasst die laufende Steuerberatung folgende, in die Vertragsdauer fallenden Tätigkeiten:

- a) Ausarbeitung der Jahressteuererklärungen für die Einkommensteuer, Körperschaftsteuer und Gewerbesteuer sowie der Vermögensteuererklärungen, und zwar auf Grund der vom Auftraggeber vorzulegenden Jahresabschlüsse und sonstiger für die Besteuerung erforderlicher Aufstellungen und Nachweise
- b) Nachprüfung von Steuerbescheiden zu den unter a) genannten Steuern
- c) Verhandlungen mit den Finanzbehörden im Zusammenhang mit den unter a) und b) genannten Erklärungen und Bescheiden
- d) Mitwirkung bei Betriebsprüfungen und Auswertung der Ergebnisse von Betriebsprüfungen hinsichtlich der unter a) genannten Steuern
- e) Mitwirkung in Einspruchs- und Beschwerdeverfahren hinsichtlich der unter a) genannten Steuern.

Der Wirtschaftsprüfer berücksichtigt bei den vorgenannten Aufgaben die wesentliche veröffentlichte Rechtsprechung und Verwaltungsauffassung.

(4) Erhält der Wirtschaftsprüfer für die laufende Steuerberatung ein Pauschalhonorar, so sind mangels anderweitiger schriftlicher Vereinbarungen die unter Abs. 3 Buchst. d) und e) genannten Tätigkeiten gesondert zu honorieren.

(5) Sofern der Wirtschaftsprüfer auch Steuerberater ist und die Steuerberatervergütungsverordnung für die Bemessung der Vergütung anzuwenden ist, kann eine höhere oder niedrigere als die gesetzliche Vergütung in Textform vereinbart werden.

(6) Die Bearbeitung besonderer Einzelfragen der Einkommensteuer, Körperschaftsteuer, Gewerbesteuer, Einheitsbewertung und Vermögensteuer sowie aller Fragen der Umsatzsteuer, Lohnsteuer, sonstigen Steuern und Abgaben erfolgt auf Grund eines besonderen Auftrags. Dies gilt auch für

- a) die Bearbeitung einmalig anfallender Steuerangelegenheiten, z.B. auf dem Gebiet der Erbschaftsteuer, Kapitalverkehrsteuer, Grunderwerbsteuer,
- b) die Mitwirkung und Vertretung in Verfahren vor den Gerichten der Finanz- und der Verwaltungsgerichtsbarkeit sowie in Steuerstrafsachen,
- c) die beratende und gutachtliche Tätigkeit im Zusammenhang mit Umwandlungen, Kapitalerhöhung und -herabsetzung, Sanierung, Eintritt und Ausscheiden eines Gesellschafters, Betriebsveräußerung, Liquidation und dergleichen und
- d) die Unterstützung bei der Erfüllung von Anzeige- und Dokumentationspflichten.

(7) Soweit auch die Ausarbeitung der Umsatzsteuerjahreserklärung als zusätzliche Tätigkeit übernommen wird, gehört dazu nicht die Überprüfung etwaiger besonderer buchmäßiger Voraussetzungen sowie die Frage, ob alle in Betracht kommenden umsatzsteuerrechtlichen Vergünstigungen wahrgenommen worden sind. Eine Gewähr für die vollständige Erfassung der Unterlagen zur Geltendmachung des Vorsteuerabzugs wird nicht übernommen.

## 12. Elektronische Kommunikation

Die Kommunikation zwischen dem Wirtschaftsprüfer und dem Auftraggeber kann auch per E-Mail erfolgen. Soweit der Auftraggeber eine Kommunikation per E-Mail nicht wünscht oder besondere Sicherheitsanforderungen stellt, wie etwa die Verschlüsselung von E-Mails, wird der Auftraggeber den Wirtschaftsprüfer entsprechend in Textform informieren.

## 13. Vergütung

(1) Der Wirtschaftsprüfer hat neben seiner Gebühren- oder Honorarforderung Anspruch auf Erstattung seiner Auslagen; die Umsatzsteuer wird zusätzlich berechnet. Er kann angemessene Vorschüsse auf Vergütung und Auslagenersatz verlangen und die Auslieferung seiner Leistung von der vollen Befriedigung seiner Ansprüche abhängig machen. Mehrere Auftraggeber haften als Gesamtschuldner.

(2) Ist der Auftraggeber kein Verbraucher, so ist eine Aufrechnung gegen Forderungen des Wirtschaftsprüfers auf Vergütung und Auslagenersatz nur mit unbestrittenen oder rechtskräftig festgestellten Forderungen zulässig.

## 14. Streitschlichtungen

Der Wirtschaftsprüfer ist nicht bereit, an Streitbeilegungsverfahren vor einer Verbraucherschlichtungsstelle im Sinne des § 2 des Verbraucherstreitbeilegungsgesetzes teilzunehmen.

## 15. Anzuwendendes Recht

Für den Auftrag, seine Durchführung und die sich hieraus ergebenden Ansprüche gilt nur deutsches Recht.