

AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI - IC

FACTSHEET

Marketing-
Anzeige

28/02/2022

STANDARD-GELDMARKTFONDS ■

Wesentliche Informationen (Quelle : Amundi)

Nettoinventarwert (NAV) : 230.807,6611 (EUR)
 Datum des NAV : 28/02/2022
 Fondsvolumen : 47.893,65 (Millionen EUR)
 ISIN-Code : FR0010251660
 Bloomberg-Code : CATRESC FP
 Reuters-Code : LP65018173
 SEDOL-Code : -
 Referenzindex : 100% €STR CAPITALISE (OIS)
 Geldmarkt-NAV-Typ : Variable Nettoinventarwert

Anlageziel (Quelle : Amundi)

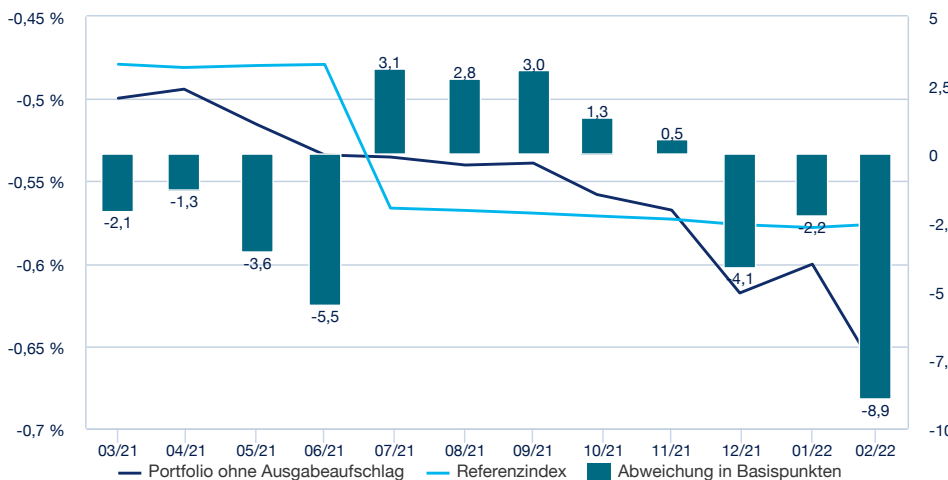
Die von uns angestrebte Wertentwicklung soll den für den Geldmarktzins in der Eurozone repräsentativen Referenzindex €str nach Berücksichtigung der laufenden Kosten übertreffen. Zu diesem Zweck wählt das Managementteam „hochwertige“ Wertpapiere in Euro oder Fremdwährungen aus, die von Privatunternehmen mit einem kurzfristigen Rating ausgegeben werden, das zumindest den beiden besten Ratings der anerkannten Agenturen entspricht, sowie von staatlichen Unternehmen mit einem bestimmten kurzfristigen Mindestrating, die nach Einschätzung derselben Agenturen zur „Investment Grade“-Kategorie gehören oder, falls kein Rating durch eine Agentur vorliegt, auf ein gleichwertiges internes Rating der Verwaltungsgesellschaft verweisen.

Gütesiegel



Fonds ohne Kapitalgarantie

Wertentwicklung (Quelle: Fondsadministrator)



Risiko- und Renditeprofil (SRRI) (Quelle: Fund Admin)



- 1 Niedrige Risiken, potenziell niedrigere Erträge
- 2 Niedrige Risiken, potenziell niedrigere Erträge
- 3 Niedrige Risiken, potenziell niedrigere Erträge
- 4 Niedrige Risiken, potenziell niedrigere Erträge
- 5 Mittlere Risiken, potenziell höhere Erträge
- 6 Hohe Risiken, potenziell höhere Erträge
- 7 Hohe Risiken, potenziell höhere Erträge

Das SRRI entspricht dem in den wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) angeführten Risiko- und Renditeprofil. Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer „risikofreien Anlage“ gleichgesetzt werden. Sie ist nicht garantiert und kann sich im Laufe der Zeit verändern.

WAM und WAL in Tagen (Quelle: Amundi)

	WAM *	WAL **
28/02/2022	35	133
31/01/2022	38	127
31/12/2021	39	125
30/11/2021	48	132
29/10/2021	59	114
30/09/2021	43	115
31/08/2021	48	116
30/07/2021	49	117
30/06/2021	52	124
31/05/2021	49	117
30/04/2021	52	114
31/03/2021	59	129

** WAL (Weighted Average Life): Abgewogene durchschnittliche Lebensdauer (DVMP), die in Anzahl der Tage ausgedrückt wurde

* WAM (Weighted Average Maturity): Abgewogene durchschnittliche Reife (MMP), die in Anzahl der Tage ausgedrückt wurde

Volatilität (Quelle: Fund Admin)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre
Portfolio Volatilität	0,01%	0,02%	0,02%	0,06%
Referenzindex Volatilität	0,01%	0,01%	0,01%	0,04%

Die Volatilität ist ein statistischer Indikator, der die Schwankungen eines Vermögenswerts um seinen Mittelwert misst. Beispielsweise entspricht eine Marktschwankung von +/- 1,5% pro Tag einer Volatilität von 25% pro Jahr.

Wertentwicklung (nach Abzug von Gebühren) * (Quelle: Fund Admin)

seit dem	Seit dem 30/12/2021	1 Monat 31/01/2022	3 Monate 30/11/2021	1 Jahr 28/02/2021	3 Jahre 28/02/2019	5 Jahre 28/02/2017	seit dem 31/08/2006
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	-0,63%	-0,66%	-0,63%	-0,56%	-0,43%	-0,36%	0,81%
Referenzindex	-0,58%	-0,58%	-0,58%	-0,55%	-0,48%	-0,43%	0,57%
Abweichung	-0,05%	-0,09%	-0,05%	-0,01%	0,05%	0,07%	0,24%

Jährliche Wertentwicklung* (Quelle: Fund Admin)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
Portfolio ohne Ausgabeaufschlag	-0,54%	-0,40%	-0,29%	-0,31%	-0,17%	0,01%	0,21%	0,46%	0,36%	0,74%
Referenzindex	-0,53%	-0,47%	-0,40%	-0,37%	-0,36%	-0,32%	-0,11%	0,10%	0,09%	0,24%
Abweichung	-0,01%	0,07%	0,10%	0,06%	0,19%	0,33%	0,32%	0,36%	0,27%	0,50%

* Die angegebene Wertentwicklung deckt für jedes Kalenderjahr vollständige 12-Monats-Zeiträume ab. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für den künftigen Wertverlauf. Der Wert der Anlagen kann in Abhängigkeit von der Marktentwicklung steigen oder fallen. Leistungen, die auf einer Basis von 360 Tagen über einen Zeitraum jährlich berechnet wurden, < 1 Jahr und 365 Tage über einen Zeitraum > 1 Jahr (Angaben in der oberen Rundung)

STANDARD-GELDMARKTFONDS ■



Patrick Simeon

Verantwortlicher für die
Währungsverwaltung

Kommentar des Managements

Geldpolitik:

Die Europäische Zentralbank ließ ihren Hauptleitzinssatz (Refi-Satz) unverändert bei 0,00 %, den Einlagenzinssatz bei -0,50 % und den Spitzenrefinanzierungszinssatz bei 0,25 %.

Die EZB verfolgt aufmerksam die Auswirkungen der Situation in der Ukraine. Auf ihrer Sitzung im März wird sie die Wirtschaftsaussichten, darunter auch die aktuellen geopolitischen Entwicklungen, umfassend bewerten.

Diese Sitzung wird daher immer wichtiger, da bei den mit Spannung erwarteten geldpolitischen Entscheidungen (Ende des Anleihekaufprogramms und Zinserhöhungen) nun neben der hohen Teuerungsrate auch die unausweichlichen wirtschaftlichen Auswirkungen der Ukraine-Krise berücksichtigt werden müssen.

Diese komplexe Situation verursachte den ganzen Monat zunehmende Kursschwankungen an den Märkten.

Anlagepolitik:

- Liquidität:

Die sofortige Liquidität wurde vor allem durch Tagesgeschäfte gesichert.

- Zinsrisiko:

Die gewichtete durchschnittliche Zinsbindungsdauer (WAM) des Portfolios betrug am Ende des Berichtszeitraums 35 Tage.

- Kreditrisiko:

Die Spreads weiteten sich am kurzen Ende der Kurve leicht. Im Falle von Laufzeiten zwischen drei Monaten und einem Jahr lagen sie bei €STR+ 4 bis €STR + 8 Bp.

Hervorzuheben ist, dass bei der Länderaufteilung kündbare Finanzinstrumente auf Basis der Endfälligkeiten und nicht auf Basis der mit dieser Art von Produkt verbundenen Option auf Rückzahlung zum Nennwert dargestellt werden.

Die Gewichtung von Schuldverschreibungen lag zum Monatsende bei ca. 14 % des Fondsvermögens, davon waren fast 2 % kündbare Finanzinstrumente, zum Großteil 3-monatige Puts.

Der Anteil der Emittenten mit BBB-Rating im Portfolio lag zum Monatsende bei rund 21 %.

- Durchschnittliche Restlaufzeit und durchschnittliches Rating:

Die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAL) dieses Portfolios der Kategorie „Geldmarktanlagen“ beträgt 133 Tage.

Das langfristige Durchschnittsrating des Portfolios ist mit A+ weiter gut.

- Dimension der sozialen Verantwortung:

Das Portfolio weist zum Monatsende eine durchschnittliche SRI-Note von C+ auf, also ein höheres Niveau als das seines Anlageuniversums (D+), nachdem 20 % der am schlechtesten bewerteten Emittenten (C-) ausgemustert wurden.

Portfoliozusammensetzung (Quelle: Amundi)

Hauptlinien in Portefeuille (Quelle : Amundi)

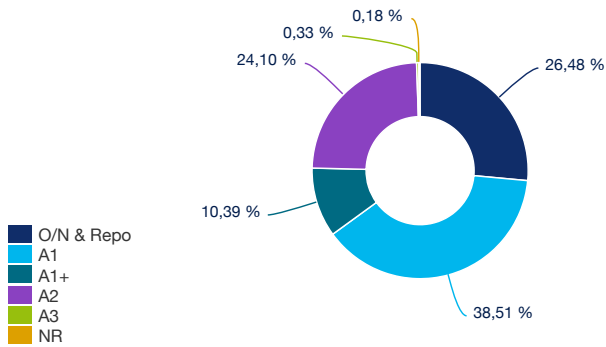
	Portfolio	Reife	Länder	Instrumentengruppe	Gegenpartei *
NORDEA BANK ABP	1,05%	03/10/2022	Finnland	Geldmarkt	-
BANQUE FED.CREDIT MUTUEL	0,92%	16/03/2022	Frankreich	Geldmarkt	-
BARCLAYS BANK PLC	0,91%	10/11/2022	Vereinigtes Königreich	Geldmarkt	-
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	0,87%	05/10/2022	Schweden	Geldmarkt	-
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	0,80%	04/01/2023	Schweden	Geldmarkt	-
SOCIETE GENERALE LUXEMBOURG	0,74%	12/12/2022	Luxemburg	Anleihen	-
AT&T INC	0,73%	01/04/2022	Vereinigte Staaten	Anleihen	-
SOCIETE GENERALE	0,73%	23/06/2022	Frankreich	Anleihen	-
BANQUE FED.CREDIT MUTUEL	0,70%	10/03/2022	Frankreich	Geldmarkt	-
NATIXIS SA	0,64%	05/10/2022	Frankreich	Geldmarkt	-

* Für Reverse-Repo-Geschäfte beträgt die Laufzeit 1 Tag. Sie entspricht dem Zeitraum, der für die Abrechnung der Transaktion vonnöten ist

* Gegenstückssäule: Informationen sind nur für Reverse-Repo-Geschäfte erhältlich

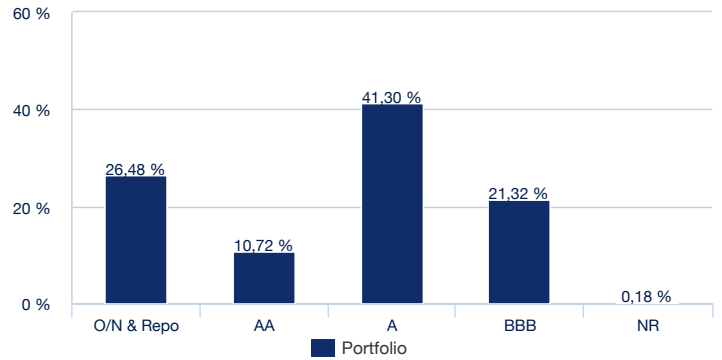
STANDARD-GELDMARKTFONDS

Aufteilung - „Kurzfristiges“ Rating (Quelle : Amundi) *



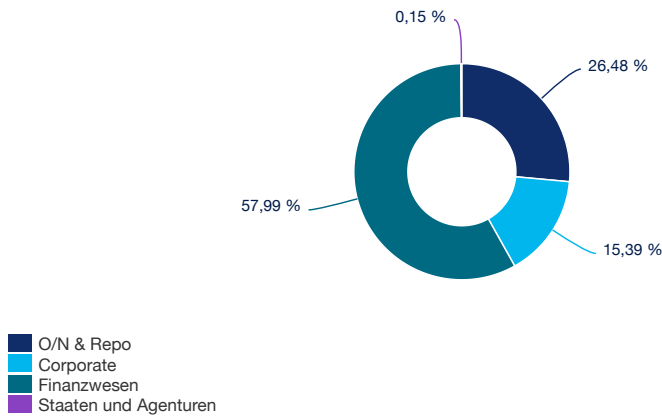
* Median der drei Agenturen: Fitch, Moody's, Standard & Poor's.

Aufteilung - „Langfristiges“ Rating (Quelle : Amundi) *

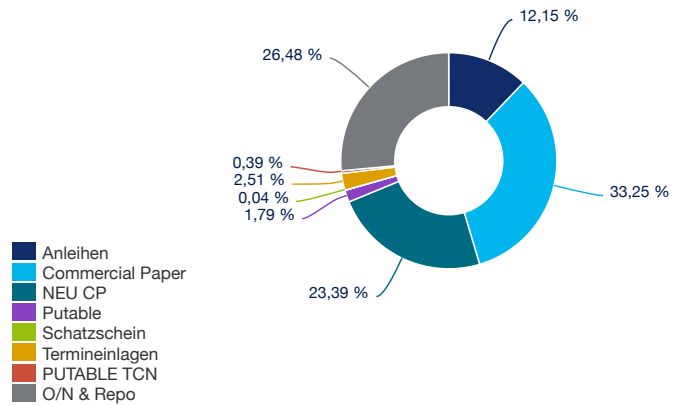


* Median der drei Agenturen: Fitch, Moody's, Standard & Poor's.

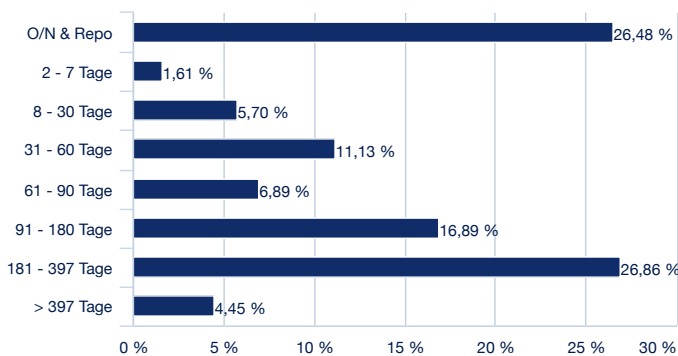
Aufteilung - Sektoren (Quelle : Amundi)



Aufteilung - Instrumente (Quelle : Amundi)



Aufteilung nach Laufzeiten (Quelle : Amundi) *



* O/N & Repo: von Tag zu Tag gesetzte flüssige Mittel

Indikatoren (Quelle : Amundi)

	Portfolio
Modifizierte Duration *	0,10
Durchschnittliches Rating	A+
Anzahl der Positionen im Portfolio	383
Gesamtzahl Emittenten	114

* Die modifizierte Duration (in Punkten) zeigt die prozentuale Änderung des Preises bei einer Veränderung des Referenzzinssatzes um 1%.

STANDARD-GELDMARKTFONDS ■

Liquiditätskennzahl * (Quelle: Amundi)

Ratio 24h	19.62 %
Weekly ratio	28.93 %

Disclaimer - Ratios Liquidity - Standard

STANDARD-GELDMARKTFONDS

Langfrist Rating/Laufzeiten (Quelle: Amundi)

	AA	AA-	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	Nicht notierten	O/N & Repo	Summe
0-4 Monate	0,52%	1,18%	13,69%	1,93%	2,33%	5,64%	6,04%	0,33%	-	26,48%	58,14%
4-12 Monate	4,51%	4,50%	13,81%	6,70%	0,69%	0,81%	6,29%	-	0,09%	-	37,42%
12-18 Monate	-	-	0,42%	0,59%	-	0,14%	1,02%	-	-	-	2,18%
18-24 Monate	-	-	0,33%	0,27%	0,55%	0,79%	0,25%	-	0,08%	-	2,27%
Summe	5,04%	5,69%	28,25%	9,49%	3,56%	7,38%	13,60%	0,33%	0,18%	26,48%	100%

Länder / Sektoren / Laufzeiten (Quelle: Amundi)

	0-1 Monat	1-3 Monate	3-6 Monate	6-12 Monate	1-2 Jahr	Summe
Eurozone	6,92%	15,69%	14,14%	15,71%	1,96%	54,42%
Belgien	-	0,33%	-	0,52%	-	0,85%
Finanzwesen	-	0,33%	-	0,52%	-	0,85%
Finnland	0,18%	0,95%	0,49%	2,08%	-	3,70%
Finanzwesen	0,18%	0,95%	0,49%	2,08%	-	3,70%
Frankreich	4,18%	8,57%	6,51%	7,76%	0,43%	27,46%
Corporate	1,14%	0,44%	0,69%	0,69%	0,26%	3,22%
Finanzwesen	3,04%	8,13%	5,82%	7,08%	0,17%	24,24%
Deutschland	0,59%	0,52%	0,54%	0,00%	0,48%	2,14%
Corporate	0,59%	0,39%	0,21%	-	0,48%	1,67%
Finanzwesen	-	0,13%	0,34%	0,00%	-	0,47%
Italien	1,82%	3,27%	4,21%	2,48%	0,25%	12,03%
Corporate	1,08%	1,68%	0,32%	-	-	3,09%
Finanzwesen	0,73%	1,59%	3,88%	2,48%	0,25%	8,94%
Luxemburg	-	0,30%	1,00%	2,00%	0,34%	3,64%
Corporate	-	-	-	-	0,34%	0,34%
Finanzwesen	-	0,30%	1,00%	2,00%	-	3,30%
Niederlande	0,08%	0,45%	0,52%	0,61%	0,45%	2,11%
Corporate	-	0,40%	0,12%	-	0,45%	0,96%
Finanzwesen	0,08%	0,05%	0,40%	0,61%	-	1,14%
Portugal	0,06%	-	-	-	-	0,06%
Corporate	0,06%	-	-	-	-	0,06%
Spanien	0,00%	1,31%	0,86%	0,26%	-	2,43%
Corporate	-	0,32%	0,76%	-	-	1,08%
Finanzwesen	-	0,86%	0,09%	0,25%	-	1,20%
Staaten und Agenturen	0,00%	0,12%	0,01%	0,01%	-	0,15%
Sonstige Ländern	-	2,72%	2,75%	11,15%	2,49%	19,10%
Australien	-	-	-	0,64%	-	0,64%
Corporate	-	-	-	0,64%	-	0,64%
Kanada	-	-	-	0,73%	0,84%	1,57%
Finanzwesen	-	-	-	0,73%	0,84%	1,57%
Dänemark	-	-	-	0,12%	-	0,12%
Finanzwesen	-	-	-	0,12%	-	0,12%
Japan	-	0,06%	0,41%	0,30%	0,42%	1,19%
Corporate	-	0,06%	0,25%	0,30%	0,42%	1,03%
Finanzwesen	-	-	0,16%	-	-	0,16%
Jersey	-	-	0,10%	-	-	0,10%
Corporate	-	-	0,10%	-	-	0,10%
Schweden	-	0,42%	1,29%	3,61%	0,44%	5,76%
Corporate	-	-	0,20%	0,04%	0,44%	0,68%
Finanzwesen	-	0,42%	1,09%	3,57%	-	5,08%
Schweiz	-	-	-	1,25%	-	1,25%
Finanzwesen	-	-	-	1,25%	-	1,25%
Vereinigtes Königreich	-	1,46%	0,92%	3,65%	-	6,03%
Corporate	-	0,15%	0,05%	-	-	0,20%
Finanzwesen	-	1,31%	0,87%	3,65%	-	5,83%
Vereinigte Staaten	-	0,77%	0,03%	0,85%	0,78%	2,44%
Corporate	-	0,77%	0,03%	0,70%	0,78%	2,29%
Finanzwesen	-	-	-	0,15%	-	0,15%
O/N & repo	26,48%	-	-	-	-	26,48%

STANDARD-GELDMARKTFONDS ■

Hauptmerkmale (Quelle: Amundi)

Rechtsform	Anlagefonds
Anwendbares Recht	französische Recht
Verwaltungsgesellschaft	Amundi Asset Management
Depotbank	CACEIS Bank
Auflagedatum der Anlageklasse	01/12/2005
Referenzwährung der Anteilsklasse	EUR
Klassifizierung	Standard-Geldmarktfonds
Ertragsverwendung	Thesaurierend
ISIN-Code	FR0010251660
Bloomberg-Code	CATRESC FP
Mindestanlagebetrag bei Erst-/Folgezeichnung	10 Anteil(e) / 1 Tausendstel-Anteil(e)/Akte(n)
Häufigkeit der Berechnung des Nettoinventarwerts	Täglich
Uhrzeit für den Handelsschluss	Anträge pro Tag T vor 12:25
Ausgabeaufschlag (maximal)	1,00%
Direkte Verwaltungsgebühren	0,50% Inkl. Steuern
Erfolgsabhängige Gebühr	Ja
Performancevergütung (% pro Jahr)	30,00%
Rücknahmeabschlag (maximal)	0,00%
Laufende Kosten	0,09% (erhoben) - 30/06/2021
Empfohlene Mindestanlagedauer	Supérieure à 1 mois
Übersicht zur Entwicklung des Referenzindex	01/07/2021: 100.00% €STR CAPITALISE (OIS) 02/07/2004: 100.00% EONIA CAPITALISE (O.I.S.) (BASE 360)
OGAW konform	OGAW
Zu aktueller/unbekanntem kurs	Zu aktueller kurs
Wertstellungstag Aufkauf	T
Wertstellungstag Subskription	T
Besonderheit	OGAW Haupt-

Ihr Fonds ist mit einem Kapitalverlustrisiko verbunden. Sein Nettoinventarwert kann schwanken und die Erhaltung des investierten Kapitals wird nicht garantiert. Der Fonds kann sich keinesfalls auf externe Faktoren stützen, um seinen Nettoinventarwert aufrechtzuerhalten oder zu stabilisieren. Eine Anlage in Geldmarktfonds kann nicht mit einer Anlage in Bankeinlagen verglichen werden.

STANDARD-GELDMARKTFONDS ■

Wichtige Hinweise

Dieses Dokument dient nur zu Informationszwecken und stellt keinesfalls eine Anlageberatung, Finanzanalyse oder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Anteilen oder Aktien der in diesem Dokument präsentierten FCP, FCPE, SICAV, SICAV-Teilfonds oder SPPICAV („die OGA“) dar und darf keinesfalls so ausgelegt werden. Dieses Dokument stellt nicht die Grundlage eines Vertrages oder einer Verpflichtung gleich welcher Art dar. Alle in diesem Dokument enthaltenen Angaben können ohne vorherige Ankündigung geändert werden. Der aktuelle Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen („KIID“), die Satzung, der Jahres- und der Halbjahresbericht sind kostenlos und in gedruckter Form bei der Zahl- und Informationsstelle (Marcard, Stein & Co AG, Ballindamm 36, D-20095 Hamburg, Deutschland) erhältlich und auf unserer Website www.amundi.com verfügbar. Die Verwaltungsgesellschaft übernimmt keinerlei Haftung, weder direkt noch indirekt, die sich durch die Nutzung sämtlicher in diesem Dokument enthaltenen Angaben ergeben könnte. Die Verwaltungsgesellschaft haftet keinesfalls für Entscheidungen, die auf Grundlage dieser Angaben getroffen werden. Die Angaben in diesem Dokument werden Ihnen auf vertraulicher Basis mitgeteilt und dürfen ohne vorherige schriftliche Zustimmung der Verwaltungsgesellschaft von keinem Dritten und in keinem Land, in dem diese Veröffentlichung oder Nutzung geltenden Rechtsvorschriften zuwiderläuft, oder demzufolge die Verwaltungsgesellschaft oder ihre Fonds verpflichtet wären, sich im besagten Land bei Aufsichtsbehörden registrieren zu lassen, weder kopiert noch vervielfältigt noch geändert noch übersetzt noch veröffentlicht werden. Nicht alle OGA sind unbedingt im jeweiligen Rechtsgebiet sämtlicher Anleger eingetragen. Anlagen beinhaltet Risiken: Die Wertentwicklungen in der Vergangenheit der in diesem Dokument präsentierten OGA sowie die auf Basis dieser Wertentwicklungen durchgeführten Simulationen sind kein verlässlicher Indikator für zukünftige Wertentwicklungen. Sie lassen keine Rückschlüsse auf den künftigen Wertverlauf zu. Der Wert der Anteile oder Aktien der OGA unterliegt den Preisschwankungen auf dem Markt. Daher können die getätigten Anlagen sowohl steigen als auch fallen. Somit können Zeichner der OGA ihr anfänglich investiertes Kapital ganz oder teilweise verlieren. An den OGA interessierte Personen müssen vor jeder Zeichnung sicherstellen, dass die Zeichnung mit den auf sie zutreffenden Gesetzen vereinbar ist, sich der steuerlichen Folgen einer solchen Anlage vergewissern und die geltenden gesetzlich vorgeschriebenen Dokumente jedes OGA zur Kenntnis nehmen. Die Daten dieses Dokuments stammen von der Verwaltungsgesellschaft (sofern nicht anders angegeben). Der Stand der Daten dieses Dokuments entspricht dem am Beginn des Abschnitts „MONATLICHE VERWALTUNGSÜBERSICHT“ angegebenen Datum (sofern nicht anders angegeben).

Dieses Dokument ist ausschließlich für institutionelle, professionelle, qualifizierte oder erfahrene Anleger und Vertriebsstellen bestimmt. Es darf nicht an die breite Öffentlichkeit, Privatkunden oder Einzelanleger in irgendeinem Land und nicht an „US-Personen“ ausgegeben werden. Darüber hinaus sollte ein solcher Anleger in der Europäischen Union ein „professioneller“ Anleger im Sinne der Richtlinie 2004/39/EG vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente („MIFID“) bzw. im Sinne der jeweiligen lokalen Vorschriften und, im Hinblick auf das Angebot in der Schweiz, ein „qualifizierter Anleger“ im Sinne der Bestimmungen des schweizerischen Gesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG), der schweizerischen Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 22. November 2006 (KKV) und des Rundschreibens 08/8 der FINMA im Sinne der Gesetzgebung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 20. November 2008 sein. Das Dokument darf in der Europäischen Union unter keinen Umständen an nicht „professionelle“ Anleger im Sinne der MIFID oder der jeweiligen lokalen Vorschriften oder in der Schweiz an Anleger, auf welche die in den geltenden Gesetzen und Vorschriften enthaltene Definition von „qualifizierten Anlegern“ nicht zutrifft, ausgegeben werden.

GELDMARKT ■

ESG-Wörterbuch

Nachhaltige Investments (SRI)

Nachhaltige Investments (Socially Responsible Investments, SRI) spiegeln die in den Anlageentscheidungen gesteckten Ziele hinsichtlich der nachhaltigen Entwicklung wider. Gleichzeitig kommen die Kriterien Umwelt, soziales Engagement und Unternehmensführung (ESG) zu den traditionellen Finanzkriterien hinzu.

Nachhaltige Investments zielen daher darauf ab, die wirtschaftliche Leistung sowie die sozialen und ökologischen Auswirkungen durch die Finanzierung von Unternehmen und öffentlichen Einrichtungen in Einklang zu bringen, die unabhängig von ihrem Unternehmenssektor zu einer nachhaltigen Entwicklung beitragen. Durch die Beeinflussung der Governance und des Verhaltens der Anteilseigner fördert SRI eine verantwortungsvolle Wirtschaft.

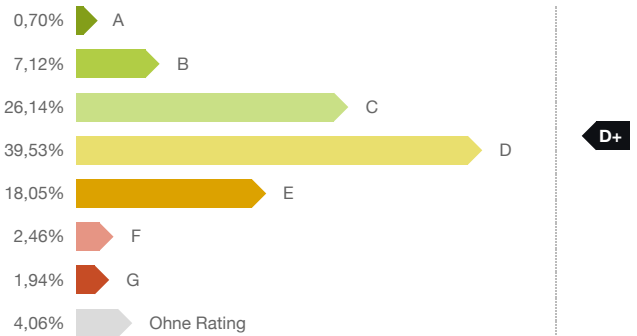
ESG Durchschnittsrating (Quelle : Amundi)

Rating für Umwelt, Soziales und Governance.

Des Portfolios²



Referenzindex³



Bewertung nach ESG Kriterien

Umwelt	C+
Sozial	C
Governance	C
Gesamtrating	C+

Benchmark ESG : ICE BOFA 1-3 YEAR GLOBAL CORPORATE INDEX

Umfang der ESG² Analyse

Anzahl Emittenten	121
Portfolioanteil der Unternehmen mit ESG-Rating in % ²	99,19%

Gütesiegel



¹ Bei der Verschlechterung der Notierung des Emittenten in E, F oder G verfügt der Investmentfondsverwalter über eine Frist von 3 Monaten, um den Titel zu verkaufen. Eine Toleranz für Fonds buy and hold ist zulässig.

² Ausstehende ESG-konforme Wertpapiere ohne Bareinlagen.

STANDARD-GELDMARKTFONDS ■

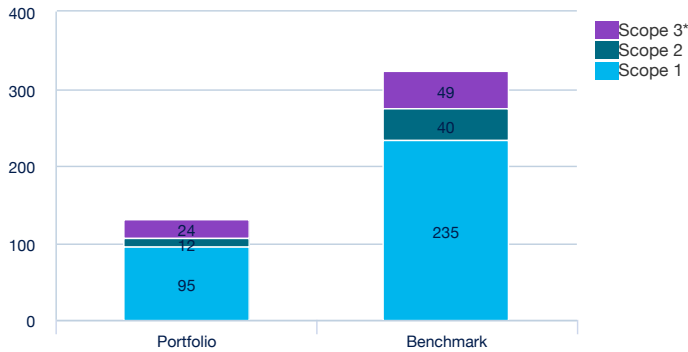
Fokus auf den Indikatoren für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung

Als Ergänzung der ESG-Gesamtwertung des Portfolios und der Dimensionen E, S und G verwendet der Anlageverwalter Wirkungsindikatoren, um die ESG-Qualität des Fonds in den Bereichen Umwelt, Soziales, gute Unternehmensführung und Einhaltung der Menschenrechte zu bewerten. Zu diesem Zweck wurden vier Leistungskriterien ausgewählt. Der Fonds verfolgt das Ziel, ein Portfolio zu halten, das bei mindestens zwei dieser Kriterien eine bessere Leistung erzielt als das Referenzanlageuniversum.*

Umwelt¹

Kohlenstoffintensität pro Million Euro Umsatz

Gesamtbetrag in Tonnen CO2/Mio. Euro (Portfolio/Index) : 131 / 323



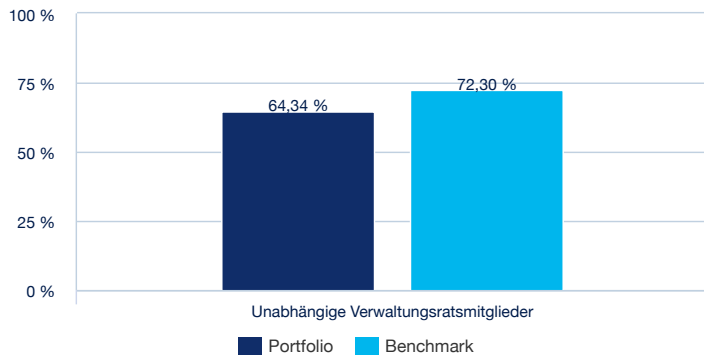
Dieser Indikator misst den Durchschnitt der Emissionen in Tonnen von CO2-Äquivalenten pro Ertragseinheit der Unternehmen (in Millionen Euro Umsatz).

* nur Lieferanten der ersten Ebene

Coverage rate (Portfolio/Benchmark) : 98,59% 94,57%

Unternehmensführung⁴

Unabhängigkeit des Verwaltungsrates

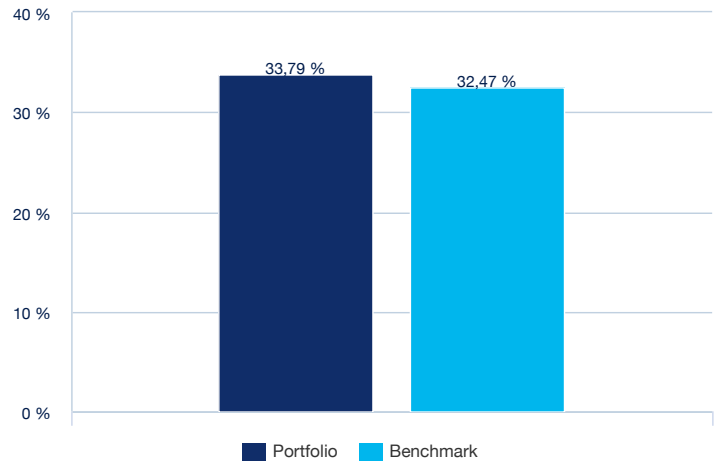


Durchschnittlicher prozentualer Anteil unabhängiger Mitglieder in den Verwaltungsräten. Datenanbieter: Refinitiv.

Abdeckungsgrad (Portfolio/Index) 79,05% 89,05%

Soziales²

Gemischte Besetzung von Führungspositionen

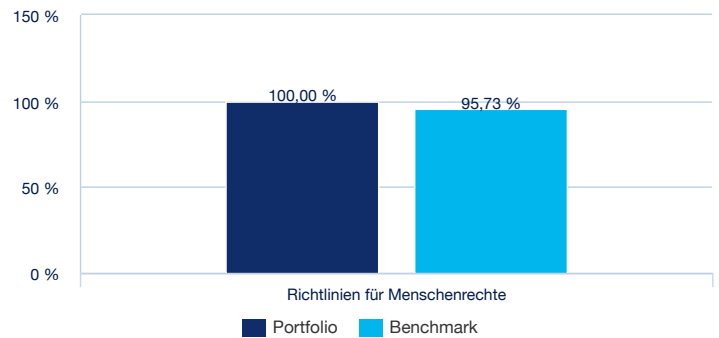


Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Führungskräfte in den Unternehmen

Abdeckungsgrad (Portfolio/Index) 76,37% 77,13%

Einhaltung der Menschenrechte

Menschenwürdige Arbeit und Vereinigungsfreiheit



Prozentualer Anteil der Unternehmen mit Richtlinien für den Ausschluss von Kinder- und Zwangsarbeit oder für die Gewährleistung der Vereinigungsfreiheit, welche unabhängig von lokalen Gesetzen universell angewendet werden. Datenanbieter: Refinitiv.

Abdeckungsgrad (Portfolio/Index) 79,05% 89,05%

STANDARD-GELDMARKTFONDS ■

Quellen und Definitionen

1. Umweltindikator/Klimaindikator. Intensität von Kohlenstoffemissionen (in Tonnen CO₂ pro Million Euro Umsatz). Diese Daten werden von Trucost zur Verfügung gestellt. Sie entsprechen den jährlichen Emissionen der Unternehmen und werden in Tonnen von CO₂-Äquivalenten ausgedrückt, d. h. sie fassen die sechs im Kyoto-Protokoll definierten Treibhausgase zusammen, deren Emissionen in Treibhauspotenziale (Global Warming Potential, GWP) in CO₂-Äquivalenten umgerechnet werden.

Definition der Scopes:

- Scope 1: Sämtliche direkten Emissionen, die aus Quellen stammen, die sich im Besitz des Unternehmens befinden oder von diesem kontrolliert werden.
- Scope 2: Sämtliche indirekten Emissionen, die durch den Kauf oder die Erzeugung von Elektrizität, Dampf oder Wärme entstehen.
- Scope 3: Sämtliche sonstigen indirekten Emissionen, die der Wertschöpfungskette vor- oder nachgelagert sind. Aus Gründen der Robustheit der Daten haben wir für diese Berichterstattung entschieden, Scope 3 nur teilweise einzubinden, nämlich unter Bezugnahme auf vorgelagerte Emissionen in Verbindung mit den Lieferanten der ersten Ebene. Lieferanten der ersten Ebene sind diejenigen, zu denen das Unternehmen eine Vorzugsbeziehung pflegt und auf die es direkt Einfluss nehmen kann.

2. Gemischte Besetzung von Führungspositionen. Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Führungskräfte. Mit diesem Indikator lässt sich die Beförderung von Frauen im Unternehmen auf umfassendere Weise berücksichtigen als bei einer Beschränkung auf den Anteil von Frauen im Verwaltungsrat. Datenanbieter: Refinitiv.

3. Indikator für die Einhaltung der Menschenrechte. Prozentualer Anteil der Unternehmen mit Richtlinien für den Ausschluss von Kinder- und Zwangsarbeit oder für die Gewährleistung der Vereinigungsfreiheit, welche unabhängig von lokalen Gesetzen universell angewendet werden. Datenanbieter: Refinitiv.

4. Unabhängigkeit des Verwaltungsrats. Durchschnittlicher prozentualer Anteil unabhängiger Mitglieder in den Verwaltungsräten. Datenanbieter: Refinitiv.

Die sich aus diesen vier Indikatoren ergebende Summe für das Portfolio/Anlageuniversum entspricht dem Durchschnitt der Indikatoren der einzelnen Unternehmen unter Berücksichtigung der Gewichtung dieser Unternehmen im Portfolio/Anlageuniversum.

* Gemäß den Regeln des SRI-Labels besteht jedoch die Möglichkeit, dass dieses Ziel punktuell nicht erreicht wird.

Dieses Dokument ist ausschließlich für institutionelle, professionelle, qualifizierte oder erfahrene Anleger und Vertriebsstellen bestimmt. Es darf nicht an die breite Öffentlichkeit, Privatkunden oder Einzelanleger in irgendeinem Land und nicht an „US-Personen“ ausgegeben werden. Darüber hinaus sollte ein solcher Anleger in der Europäischen Union ein „professioneller“ Anleger im Sinne der Richtlinie 2004/39/EG vom 21. April 2004 über Märkte für Finanzinstrumente („MIFID“) bzw. im Sinne der jeweiligen lokalen Vorschriften und, im Hinblick auf das Angebot in der Schweiz, ein „qualifizierter Anleger“ im Sinne der Bestimmungen des schweizerischen Gesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG), der schweizerischen Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 22. November 2006 (KKV) und des Rundschreibens 08/8 der FINMA im Sinne der Gesetzgebung über die kollektiven Kapitalanlagen vom 20. November 2008 sein. Das Dokument darf in der Europäischen Union unter keinen Umständen an nicht „professionelle“ Anleger im Sinne der MIFID oder der jeweiligen lokalen Vorschriften oder in der Schweiz an Anleger, auf welche die in den geltenden Gesetzen und Vorschriften enthaltene Definition von „qualifizierten Anlegern“ nicht zutrifft, ausgegeben werden.