

AMUNDI CAC 40 ESG UCITS ETF DR - EUR

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/05/2025

ACTIONS ■

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : (C) 136,42 (EUR)
(D) 81,37 (EUR)

Date de VL et d'actif géré : 30/05/2025

Actif géré : 815,88 (millions EUR)

Code ISIN : (C) LU1681046931
(D) LU1681047079

Type de Réplication : Physique

Indice de référence : 100% CAC 40 ESG

Objectif d'investissement

AMUNDI CAC 40 ESG - UCITS ETF DR a pour objectif de répliquer au plus près l'évolution de l'indice CAC 40 ESG (dividendes nets réinvestis), à la hausse comme à la baisse. Cet ETF permet une exposition aux 40 valeurs phares de la place de Paris qui mettent en œuvre de bonnes pratiques environnementales, sociales et de gouvernance au sein de l'Indice CAC Large 60 afin de réduire l'empreinte carbone pondérée et à améliorer le ratio vert/marron par rapport à l'Indice cadre. En outre, les sociétés dont l'activité est liée aux armes controversées, aux armes à feu civiles, à l'extraction de charbon thermique, à la production d'énergie alimentée au charbon, au sable bitumineux, au pétrole et au tabac sont exclues. Chaque composante est pondérée par sa capitalisation boursière flottante avec un plafond de 10%. Pour plus d'information concernant la méthodologie de l'indice, consultez le prospectus du fonds ou le KIID.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 5 ans. Le SRI représente le profil de risque tel qu'exposé dans le Document d'Information Clé (DIC). La catégorie la plus basse ne signifie pas qu'il n'y a pas de risque. L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Performances (Source : Fund Admin) - Les performances passées ne préjugent pas des performances futures

Evolution de la performance (VL) * (Source : Fund Admin)



A : Sur la base des performances, de la date de lancement à la date d'absorption du Fonds français « AMUNDI ETF CAC 40 UCITS ETF DR » géré par Amundi Asset Management, et absorbé par « AMUNDI CAC 40 » le 14/02/2018.

B : Performance du Compartiment depuis la date de son lancement

C : Depuis cette date, le compartiment est passé du CAC 40 au CAC 40 ESG

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

| | 1 an | 3 ans | Depuis le lancement * |
|----------------------------|--------|--------|-----------------------|
| Volatilité du portefeuille | 17,55% | 16,47% | 20,10% |
| Volatilité de l'indice | 17,53% | 16,48% | 20,11% |
| Tracking Error ex-post | 0,28% | 0,27% | 0,26% |
| Ratio de sharpe | 0,00 | 0,47 | 0,35 |

* La volatilité est un indicateur statistique qui mesure l'amplitude des variations d'un actif autour de sa moyenne. Exemple : des variations de +/- 1,5% par jour sur les marchés correspondent à une volatilité de 25% par an. L'indicateur Tracking Error mesure l'écart de rendement entre le fonds et l'indice

Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

| Depuis le | Depuis le 31/12/2024 | 1 mois 30/04/2025 | 3 mois 28/02/2025 | 1 an 31/05/2024 | 3 ans 31/05/2022 | 5 ans 29/05/2020 | Depuis le 28/02/2003 |
|--------------|----------------------|-------------------|-------------------|-----------------|------------------|------------------|----------------------|
| Portefeuille | 9,05% | 4,43% | -0,21% | 3,20% | 35,83% | 95,30% | 474,35% |
| Indice | 8,48% | 3,93% | -0,76% | 2,67% | 33,72% | 90,11% | 418,88% |
| Ecart | 0,57% | 0,50% | 0,55% | 0,54% | 2,11% | 5,19% | 55,48% |

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

| | 2024 | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 |
|--------------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|
| Portefeuille | 3,34% | 21,17% | -9,08% | 31,61% | -5,15% | 30,19% | -8,21% | 12,51% | 8,63% | 11,74% |
| Indice | 2,82% | 20,55% | -9,54% | 31,07% | -5,57% | 29,24% | -8,88% | 11,69% | 7,67% | 10,92% |
| Ecart | 0,51% | 0,62% | 0,46% | 0,53% | 0,42% | 0,95% | 0,67% | 0,82% | 0,96% | 0,82% |

* Source : Amundi. Les performances ci-dessus couvrent des périodes complètes de 12 mois pour chaque année civile. Les performances passées ne préjugent en rien des résultats actuels et futurs et ne sont pas garanties des rendements à venir. Les gains ou pertes éventuels ne prennent pas en compte les frais, commissions et redevances éventuels supportés par l'investisseur lors de l'émission et du rachat des parts (ex : taxes, frais de courtage ou autres commissions prélevés par l'intermédiaire financier...). Si les performances sont calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactées par les fluctuations des taux de change (à la hausse comme à la baisse). L'écart correspond à la différence de performance du portefeuille et de l'indice.

ACTIONS ■

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice CAC 40 ESG est un indice d'actions représentatif des 40 principales sociétés démontrant de solides pratiques environnementales, sociales et de gouvernance au sein de l'Indice CAC Large 60 (Indice cadre) représentant les 60 principaux titres négociés sur la Bourse de Paris. L'Indice vise à générer une empreinte carbone pondérée réduite et à améliorer le ratio vert/brun par rapport à son Indice cadre.

Caractéristiques (Source : Amundi)

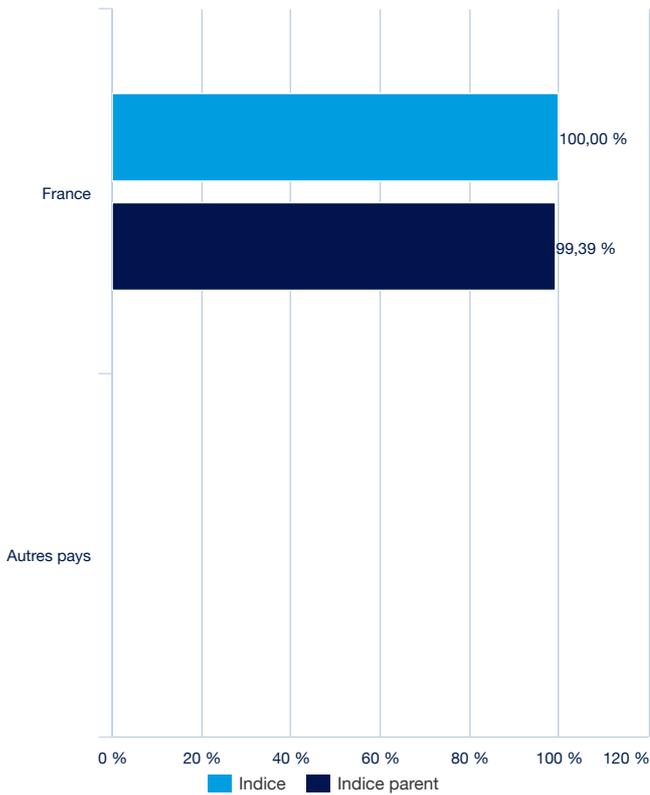
Classe d'actif : **Actions**
Exposition : **Europe**
Devise de référence de l'indice : **EUR**
Nombre de valeurs : **40**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

| | % d'actifs (indice) | % d'actifs (Indice parent) |
|------------------------------|---------------------|----------------------------|
| SCHNEIDER ELECT SE | 8,41% | 6,85% |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 7,08% | 6,43% |
| AIR LIQUIDE SA | 6,97% | 5,67% |
| SANOFI - PARIS | 6,61% | 5,38% |
| AIRBUS SE | 6,37% | 5,18% |
| SAFRAN SA | 6,28% | 5,11% |
| L OREAL (PARIS) | 5,93% | 4,82% |
| BNP PARIBAS | 5,48% | 4,46% |
| AXA SA | 5,13% | 4,18% |
| HERMES INTERNATIONAL | 5,09% | 4,14% |
| Total | 63,35% | 52,22% |

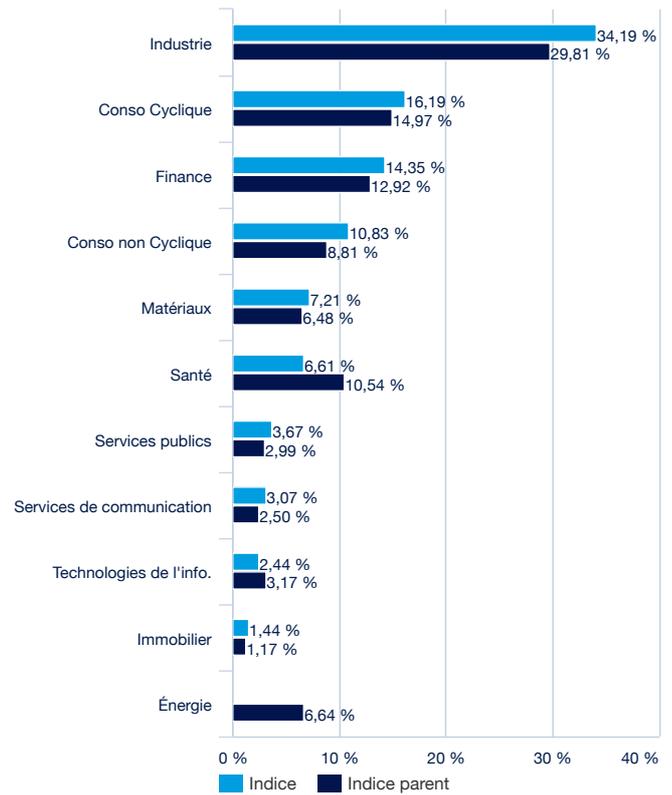
Indice parent : **CAC LARGE 60**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **CAC LARGE 60**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **CAC LARGE 60**

ACTIONS ■

Investissement Socialement Responsable (ISR)

L'ISR traduit les objectifs du développement durable dans les décisions d'investissements en ajoutant les critères Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance (ESG) en complément des critères financiers traditionnels.

L'ISR vise ainsi à concilier performance économique et impact social et environnemental en finançant les entreprises et les entités publiques qui contribuent au développement durable quel que soit leur secteur d'activité. En influençant la gouvernance et le comportement des acteurs, l'ISR favorise une économie responsable.

Evaluation par critère ESG (Source : Amundi)

| | Indice | PTF |
|---------------|--------|------|
| Note Globale | 7,23 | 7,23 |
| Environnement | 6,74 | 6,74 |
| Social | 4,64 | 4,64 |
| Gouvernance | 6,40 | 6,40 |

Indice parent : **CAC LARGE 60**

Critères ESG

Les critères sont des critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques environnementales, sociales et de gouvernance des entreprises.

Les risques et opportunités environnementaux, sociaux et de gouvernance sont triés par grandes tendances (par exemple, le changement climatique, la rareté des ressources, les changements démographiques) ainsi que par la nature des opérations de l'entreprise .

Les scores sont sur une échelle de 0 à 10, 10 étant le meilleur.

«**E**» pour **Environnement** (changement climatique, ressources naturelles, pollution & déchets et opportunités environnementales)

«**S**» pour **Social** (ressource humaine, fiabilité des produits, opposition des parties prenantes et opportunités sociales)

«**G**» pour **Gouvernance** (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

Source : Les données ESG brutes des entreprises sont fournies par l'agence MSCI

Empreinte Carbone

Emissions carbone par million d'euros investis

| Total en tCO ₂ / M€ (Indice/Indice parent) : | Indice | Indice parent |
|---|--------|---------------|
| | 75,87 | 115,24 |

Empreinte Carbone

Cet indicateur mesure les émissions du portefeuille en tonnes de CO₂ équivalent par million d'euros investis.

Il est un indicateur des émissions induites par l'investissement dans ce portefeuille.

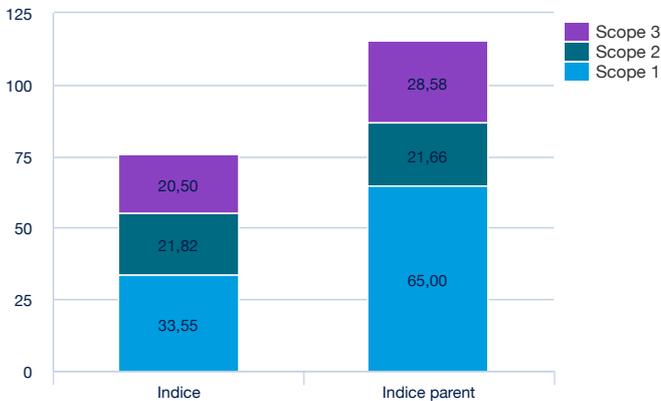
Définition des scopes :

- **Scope 1** : Ensemble des émissions directes provenant de sources détenues ou contrôlées par l'entreprise.

- **Scope 2** : L'ensemble des émissions indirectes induites par l'achat ou la production d'électricité, de vapeur ou de chaleur.

- **Scope 3** : Toutes les autres émissions indirectes, en amont et en aval de la chaîne de valeur. Pour des raisons de robustesse des données, Amundi a choisi d'utiliser les émissions provenant des activités en amont du scope 3 - Source : modèle EEI-O Trucost (modèle d'entrée/sortie étendu à l'environnement de Trucost).

Source : Les données sur émissions carbonees sont fournies par Trucost. Elles correspondent aux émissions annuelles des entreprises et sont exprimées en tonnes équivalent CO₂, i.e. elles regroupent les six gaz à effet de serre définis dans le protocole de Kyoto dont les émissions sont converties en potentiel de réchauffement global (PRG) en équivalent CO₂.



Indice parent : **CAC LARGE 60**

ACTIONS ■

Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)

| | |
|---|--|
| Forme juridique | SICAV de droit Luxembourgeois |
| Norme européenne | OPCVM |
| Société de gestion | Amundi Luxembourg SA |
| Valorisateur | CACEIS Bank, Luxembourg Branch |
| Dépositaire | CACEIS Bank, Luxembourg Branch |
| Commissaire aux comptes | PRICEWATERHOUSECOOPERS LUXEMBOURG |
| Date de création de la classe | 14/02/2018 |
| Date de la première VL | 28/02/2003 |
| Devise de référence de la classe | EUR |
| Classification AMF | - |
| Affectation des sommes distribuables | (C) Capitalisation (D) Distribution |
| Code ISIN | (C) LU1681046931 (D) LU1681047079 |
| Minimum de souscription marché secondaire | 1 Part(s) |
| Périodicité de calcul de la VL | Quotidienne |
| Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation | 0,25% |
| Clôture fiscale | Septembre |

Données de cotation de l'ETF (source : Amundi)

| Place de cotation | Horaires de cotation | Devise | Mnémo | Ticker Bloomberg | iNAV Bloomberg | RIC Reuters | iNAV Reuters |
|---------------------|----------------------|--------|-------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| Nyse Euronext Paris | 9:05 - 17:35 | EUR | C40 | C40 FP | INC40 | C40.PA | INC40INAV.PA |
| Deutsche Börse | 9:00 - 17:30 | EUR | GC40 | GC40 GY | INC40 | GC40.DE | INC40INAV.PA |
| Borsa Italiana | 9:00 - 17:30 | EUR | C40 | C40 IM | INC40INAV.MI | C40.MI | .INC40 |
| Six Swiss Exchange | 9:00 - 17:30 | EUR | C40 | C40 SW | INC40INAV.S | C40.S | .INC40 |
| BIVA | - | EUR | C40N | C40N MM | - | - | - |

Contact

Contact ETF vente

| | |
|-------------------------|-----------------------|
| France & Luxembourg | +33 (0)1 76 32 65 76 |
| Allemagne & Autriche | +49 (0) 800 111 1928 |
| Italie | +39 02 0065 2965 |
| Suisse (Allemand) | +41 44 588 99 36 |
| Suisse (Français) | +41 22 316 01 51 |
| Royaume-Uni | +44 (0) 20 7 074 9598 |
| UNITED KINGDOM (Instit) | +44 (0) 800 260 5644 |
| Pays-Bas | +31 20 794 04 79 |
| Pays Nordiques | +46 8 5348 2271 |
| Hong Kong | +65 64 39 93 50 |
| Espagne | +34 914 36 72 45 |

Contact ETF Capital Market

| | |
|-------------------|-------------------------------|
| Téléphone | +33 (0)1 76 32 19 93 |
| Bloomberg IB Chat | Capital Markets Amundi ETF |
| | Capital Markets Amundi HK ETF |

Contact ETF Courtiers

| | |
|------------------|----------------------|
| BNP Paribas | +33 (0)1 40 14 60 01 |
| Kepler Cheuvreux | +33 (0)1 53 65 35 25 |

Contact Amundi

Amundi ETF
90 bd Pasteur
CS 21564
75 730 Paris Cedex 15 - France
Hotline : +33 (0)1 76 32 47 74
info-etf@amundi.com

Fournisseurs d'indices

Avertissement

Document simplifié et non contractuel, destiné à être remis exclusivement aux porteurs de parts. Les caractéristiques principales du fonds sont mentionnées dans sa documentation juridique, disponible sur le site de l'AMF ou sur simple demande au siège social de la société de gestion. La documentation juridique vous est remise avant toute souscription à un fonds. La durée du fonds est illimitée. Investir implique des risques : les valeurs des parts ou actions des OPC sont soumises aux fluctuations du marché, les investissements réalisés peuvent donc varier tant à la baisse qu'à la hausse. Par conséquent, les souscripteurs des OPC peuvent perdre tout ou partie de leur capital initialement investi. Il appartient à toute personne intéressée par les OPC, préalablement à toute souscription, de s'assurer de la compatibilité de cette souscription avec les lois dont elle relève ainsi que des conséquences fiscales d'un tel investissement et de prendre connaissance des documents réglementaires en vigueur de chaque OPC. La source des données du présent document est Amundi sauf mention contraire. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.

Certaines informations © 2021 MSCI ESG Research LLC. Reproduit avec permission. Bien que les fournisseurs d'informations d'Amundi, y compris, sans s'y limiter, MSCI ESG Research LLC et ses sociétés affiliées (les «Parties ESG»), obtiennent des informations (les «Informations») auprès de sources qu'elles jugent fiables, aucune des parties ESG ne garantit ni l'originalité, l'exactitude et / ou l'exhaustivité des données contenues dans le présent document et déclinent expressément toutes les garanties expresses ou implicites, y compris celles de qualité marchande et d'adéquation à un usage particulier. Les informations ne peuvent être utilisées que pour votre usage interne, ne peuvent être reproduites ou rediffusées sous quelque forme que ce soit et ne peuvent pas être utilisées comme base ou composante de tout instrument financier, produit ou indice. De plus, aucune des informations ne peut être utilisée en soi pour déterminer quels titres acheter ou vendre ou quand les acheter ou les vendre. Aucune des parties ESG ne sera tenue responsable des erreurs ou omissions en relation avec les données contenues dans le présent document, ni de toute responsabilité pour tout dommage direct, indirect, spécial, punitif, consécutif ou tout autre dommage (y compris les profits perdus), même en cas de notification de la possibilité de tels dommages.