

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/05/2025

**ACTIONS** 

### Données clés (Source: Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : 95,78 ( EUR )
Date de VL et d'actif géré : 30/05/2025
Actif géré : 218,82 ( millions EUR )
Code ISIN : LU2109787635
Type de Réplication : Physique

Indice de référence :

100% MSCI EMU SRI FILTERED PAB

### Objectif d'investissement

AMUNDI INDEX MSCI EMU SRI PAB - UCITS ETF DR a pour objectif de répliquer le plus fidèlement possible la performance de l'indice MSCI EMU SRI FILTERED PAB (dividendes nets réinvestis) à la hausse comme à la baisse.

Pour de plus amples informations, veuillez-vous référer au KIID et au prospectus du fonds ainsi qu'à la Méthodologie des indices MSCI pour une description complète des critères d'exclusion.

#### 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 : Jusqu'à la fin de cette période, l'indicateur de référence du Compartiment a été MSCI EMU SRI 5% Issuer Capped

B : Since the beginning of this period, the reference indicator of the sub-fund is MSCI EMU SRI Filtered PAB

### Performances glissantes \* (Source : Fund Admin)

	Depuis le	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	Depuis le
Depuis le	31/12/2024	30/04/2025	28/02/2025	31/05/2024	31/05/2022	29/05/2020	15/05/2020
Portefeuille	8,64%	4,61%	1,89%	10,01%	39,72%	75,51%	91,57%
Indice	8,35%	4,39%	1,65%	9,76%	38,68%	72,30%	88,07%
Ecart	0,29%	0,22%	0,25%	0,25%	1,04%	3,20%	3,50%

### Performances calendaires \* (Source : Fund Admin)

	2024	2023	2022	2021	2020
Portefeuille	12,60%	15,25%	-13,67%	23,40%	-
Indice	12,35%	14,93%	-13,95%	22,58%	-
Ecart	0,24%	0,32%	0,28%	0,81%	-

# Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	14,02%	14,80%	16,81%
Volatilité de l'indice	14,01%	14,80%	16,81%
Tracking Error expost	0,12%	0,15%	0,23%
Ratio de sharpe	0,49	0,62	0,73

\* 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





<sup>\*</sup> 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 garantes 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 acludées 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.





### Rencontrez l'équipe



Lionel Brafman
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



Jerome Gueguen
Gérant de portefeuille



### Données de l'indice (Source : Amundi)

### Description de l'indice

L'Indice MSCI EMU SRI Filtered PAB est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI EMU représentatif des titres de moyenne à grande capitalisation de 10 pays développés de l'Union économique et monétaire de l'Union européenne (en novembre 2021) (l'« Indice parent »). L'Indice offre une exposition aux sociétés assorties de notations exceptionnelles en matière environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) et exclut les sociétés dont les produits ont un impact social ou environnemental négatif. En outre, l'Indice vise à représenter la performance d'une stratégie qui pondère à nouveau les titres en fonction des opportunités et des risques liés à la transition climatique afin de répondre aux exigences minimales des réglementations de l'Union européenne relatives à l'Accord de Paris (EU PAB).

### Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : Actions Exposition : Zone Euro

Devise de référence de l'indice : EUR

Nombre de valeurs : 67

### Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
SCHNEIDER ELECT SE	5,06%	2,12%
ASML HOLDING NV	5,02%	4,51%
NOKIA OYJ	4,95%	0,43%
DASSAULT SYSTEMES SE	4,84%	0,39%
HERMES INTERNATIONAL	4,82%	1,35%
AXA SA	4,79%	1,29%
DEUTSCHE BOERSE AG	4,25%	0,94%
WOLTERS KLUWER	3,28%	0,65%
ADIDAS AG	3,16%	0,66%
LEGRAND SA	2,75%	0,49%
Total	42.93%	12.82%

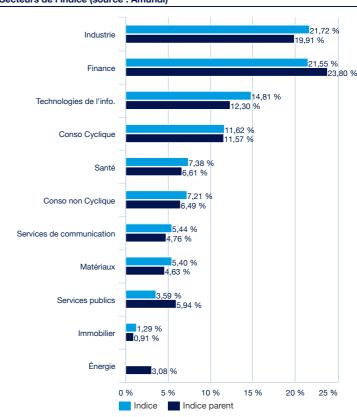
Indice parent : MSCI EMU

### Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)

### 29.00 % France 21.19 % Pays-Bas 13.01 % 17,08 % Allemagne 29,39 % Finlande 7,10 % Italie 8.93 % 6.17 % Belgique 2,76 % 2.19 % Autriche 0.59 % 1 33 % 0,92 % 0.31 % Autres pays 35 % 0 % 5 % 10 % 15 % 20 % 25 % 30 % Indice Indice parent

Indice parent : MSCI EMU

## Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : MSCI EMU







### 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	8,89	8,89
Environnement	7,35	7,35
Social	5,96	5,96
Gouvernance	6,99	6,99

Indice parent : MSCI EMU

#### 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.

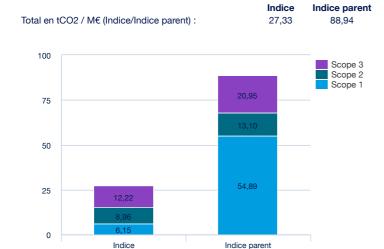
Les scores sont sur une échelle de 0 à 10, 10 étant le meilleur.

- «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



Indice parent : MSCI EMU

#### **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 carbones 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.







# 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	10/03/2020
Date de la première VL	10/03/2020
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	-
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	LU2109787635
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	0,18%
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	EESG	EESG FP	ISRHE	LES2.PA	ISRHEINAV.PA
London Stock Exchange	8:00 - 16:30	GBX	SRHE	SRHE LN	-	SRHE.L	-
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	SRHE	SRHE GY	ISRHE	SRHE.DE	ISRHEINAV.PA
Borsa Italiana	9:00 - 17:30	EUR	<b>CMUSRI</b>	CMUSRI IM	ISRHE	CMUSRI.MI	ISRHEINAV.PA
Six Swiss Exchange	-	EUR	SRHE	SRHE SW	ISRHE	SRHE.S	-
Nyse Euronext Amsterdam	9:05 - 17:35	CHF	LESE	LESE NA	ILESE	LESE.AS	ILESECHFINAV=SOLA

# Contact

Contact ETF vente		Contact ETF Capital Market				
France & Luxembourg Allemagne & Autriche Italie	+33 (0)1 76 32 65 76 +49 (0) 800 111 1928 +39 02 0065 2965	Téléphone Bloomberg IB Chat	+33 (0)1 76 32 19 93 Capital Markets Amundi ETF Capital Markets Amundi HK ETF			
Suisse (Allemand) +41 44 588 99 36		Contact ETF Courtiers				
Suisse (Français) +41 22 316 01 51  Royaume-Uni +44 (0) 20 7 074 9598  UNITED KINGDOM (Instit) +44 (0) 800 260 5644	BNP Paribas Kepler Cheuvreux	+33 (0)1 40 14 60 01 +33 (0)1 53 65 35 25				
Pays-Bas Pays Nordiques	ordiques +46 8 5348 2271 ong +65 64 39 93 50	Contact Amundi				
Hong Kong Espagne		Amundi ETF 90 bd Pasteur CS 21564 75 730 Paris Codey 15 - France	0			

75 730 Paris Cedex 15 - France **Hotline :** +33 (0)1 76 32 47 74 info-etf@amundi.com







# Fournisseurs d'indices

LE COMPARTIMENT N'EST PAS SPONSORISÉ, AVALISÉ, VENDU OU PROMU PAR MSCI INC. (« MSCI »), NI PAR L'UNE DE SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES, L'UN DE SES FOURNISSEURS D'INFORMATIONS OU AUCUN TIERS CONCERNÉ PAR LA COMPOSITION OU LA CRÉATION D'UN INDICE MSCI (COLLECTIVEMENT, LES « PARTIES MSCI »). LES INDICES MSCI SONT LA PROPRIÉTÉ EXCLUSIVE DE MSCI ET SONT DES MARQUES DE SERVICE DE MSCI OU DE SES AFFILIÉS. LES INDICES MSCI ONT FAIT L'OBJET D'UNE LICENCE ACCORDÉE, POUR CERTAINS BESOINS, À AMUNDI. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT DE DÉCLARATION, NI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR OU AUX PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU À TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, CONCERNANT LA PERTINENCE D'INVESTIR DANS LES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS CE COMPARTIMENT EN PARTICULIER. OU LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ BOURSIER CORRESPONDANT. MSCI OU SES SOCIÉTÉS AFFILIÉES SONT LES CONCÉDANTS DE LA LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, MARQUES DE SERVICE ET NOMS COMMERCIAUX, AINSI QUE DES INDICES MSCI DÉTERMINÉS, COMPOSÉS ET CALCULÉS PAR MSCI, INDÉPENDAMMENT D'AMUNDI, DE CE COMPARTIMENT, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST TENUE DE PRENDRE EN COMPTE LES BESOINS D'AMUNDI, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ DANS LE CADRE DE LA DÉFINITION. DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DES INDICES MSCI. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE DE LA DÉTERMINATION DE LA DATE DE LANCEMENT, DU PRIX OU DE LA QUANTITÉ DES ACTIONS DU COMPARTIMENT, NI DE LA DÉTERMINATION OU DU CALCUL DE LA FORMULE/DES CRITÈRES SELON LESQUELS, LE COMPARTIMENT EST REMBOURSABLE, TOUTES OPÉRATIONS AUXQUELLES AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A PRIS PART. PAR AILLEURS, AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A D'OBLIGATION OU DE RESPONSABILITÉ À L'ÉGARD DE L'ÉMETTEUR, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ RELATIVEMENT À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION ET À L'OFFRE DE CE COMPARTIMENT. BIEN QUE MSCI OBTIENNE DES INFORMATIONS À INCLURE OU À UTILISER DANS LE CALCUL DES INDICES MSCI PROVENANT DE SOURCES QUE MSCI CONSIDÈRE FIABLES, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, LA PRÉCISION ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, LES RÉSULTATS DEVANT ÊTRE OBTENUS PAR L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT, LES PORTEURS DE PARTS DE CE DERNIER OU TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ, ET PROVENANT DE L'UTILISATION DE TOUT INDICE MSCI OU DE TOUTE INFORMATION Y FIGURANT. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE PEUT ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUTE ERREUR. OMISSION OU INTERRUPTION RELATIVES AUX INDICES MSCI OU À TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE DONNE DE GARANTIE EXPRESSE OU IMPLICITE DE QUELQUE SORTE QUE CE SOIT, ET LES PARTIES MSCI NE DONNENT AUCUNE GARANTIE DE QUALITÉ MARCHANDE ET D'ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER EN CE QUI CONCERNE LES INDICES MSCI ET TOUTE DONNÉE Y FIGURANT. SANS PRÉJUDICE DE CE QUI PRÉCÈDE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE POURRA ÊTRE TENUE RESPONSABLE DE TOUS DOMMAGES DIRECTS, INDIRECTS, SPÉCIAUX, PUNITIFS, CONSÉCUTIFS OU AUTRES (Y COMPRIS TOUTE PERTE DE BÉNÉFICES), QUAND BIEN MÊME ELLE AURAIT ÉTÉ AVISÉE DE L'ÉVENTUALITÉ DE TELS DOMMAGES.

# 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.

