

AMUNDI MDAX ESG UCITS ETF

ACTION ■

REPORTING

Communication
Publicitaire

31/03/2024

Données clés (Source : Amundi)

Valeur Nette d'Inventaire (VNI) : **23,40 (EUR)**
Date de la VNI : **28/03/2024**
Actif géré : **156,41 (millions EUR)**
Code ISIN : **LU2611731667**
Type de Réplication : **Physique**
Indice de référence : **100% MDAX ESG+**

Objectif d'investissement

L'objectif de ce Compartiment est de répliquer la performance de l'Indice Dax (l'« Indice ») et de minimiser l'écart de suivi entre la valeur d'actif nette du Compartiment et la performance de l'Indice. Le Compartiment vise à atteindre un niveau d'écart de suivi du Compartiment et de son indice qui ne dépassera normalement pas 1 %.

Indicateur de risque (Source : Fund Admin)



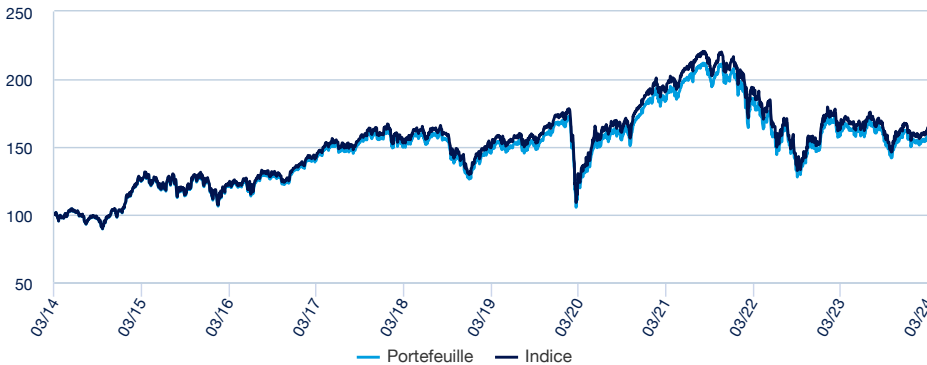
Risque le plus faible

Risque le plus élevé

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous gardez le produit pendant 5 ans. 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)



Performances glissantes * (Source : Fund Admin)

Depuis le	Depuis le 29/12/2023	1 mois 29/02/2024	3 mois 29/12/2023	1 an 31/03/2023	3 ans 31/03/2021	5 ans 29/03/2019	Depuis le 24/03/2014
Portefeuille	-1,90%	3,51%	-1,90%	-3,83%	-14,45%	8,65%	62,49%
Indice	-1,87%	3,53%	-1,87%	-3,75%	-15,01%	9,04%	67,63%
Ecart	-0,03%	-0,02%	-0,03%	-0,08%	0,57%	-0,39%	-5,14%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2023	2022	2021	2020	2019
Portefeuille	9,77%	-27,99%	-	-	-
Indice	9,89%	-28,83%	-	-	-
Ecart	-0,12%	0,84%	-	-	-

Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	14,76%	19,13%	18,81%
Volatilité de l'indice	14,79%	18,99%	18,77%
Tracking Error ex-post	0,09%	0,86%	0,47%
Ratio de sharpe	-0,51	-0,36	0,24

* 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

* 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 calculées dans une devise autre que l'euro, les gains ou les pertes éventuellement générés peuvent de ce fait être impactés 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.

ACTION

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice est un indice d'actions basé sur l'Indice MDAX (l'« Indice parent ») représentatif des sociétés à moyenne capitalisation (mid-caps) en Allemagne de secteurs traditionnels, tels que les médias, les produits chimiques, l'industrie, les services financiers et la technologie qui suivent les sociétés du MDAX en termes de capitalisation boursière et de chiffre d'affaires sur la base du carnet de commandes. L'indice exclut les entreprises dont les produits ont des impacts sociaux ou environnementaux négatifs, tout en surpondérant les entreprises ayant un score ESG élevé.

Caractéristiques (Source : Amundi)

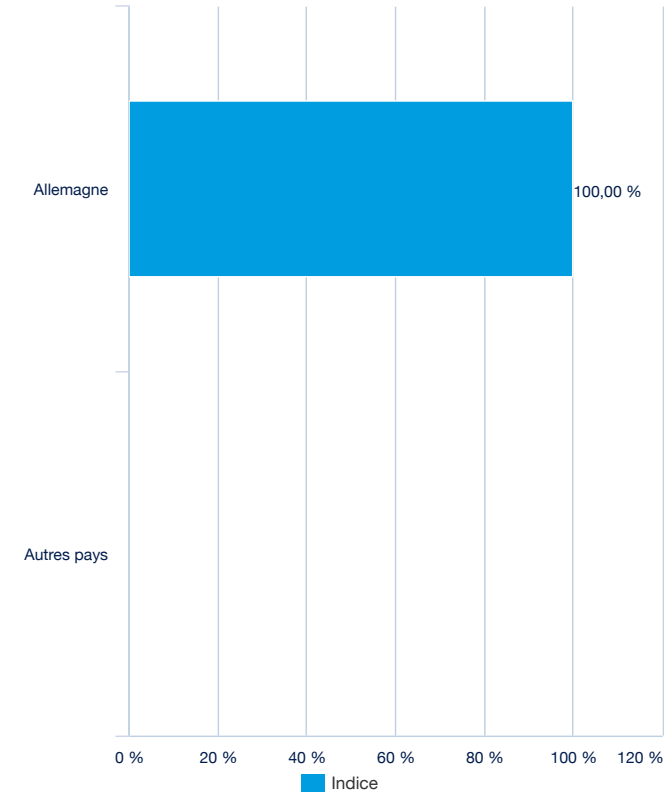
Classe d'actif : **Action**
Exposition : **Allemagne**
Devise de référence de l'indice : **EUR**
Nombre de valeurs : **40**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
DEUTSCHE LUFTHANSA	6,23%	-
FRESEN MED CARE AG	5,97%	-
GEA GROUP AG	5,18%	-
LEG IMMOBILIEN AG	4,96%	-
SCOUT24 SE	4,41%	-
NEMETSCHKE AG	4,38%	-
KNORR-BREME AG	3,90%	-
PUMA SE	3,73%	-
TALANX AG	3,71%	-
CARL ZEISS MEDITEC	3,56%	-
Total	46,03%	-

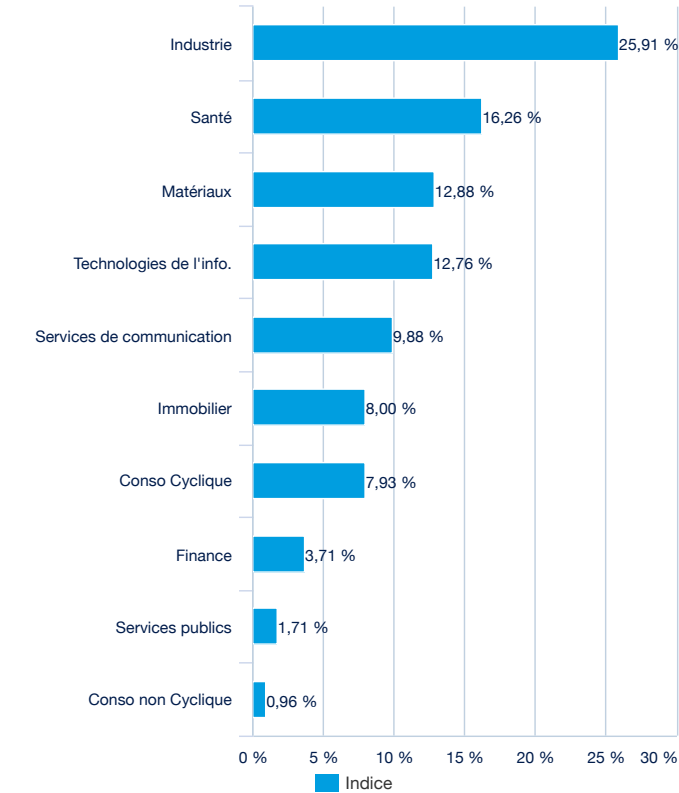
Indice parent :

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent :

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent :

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.

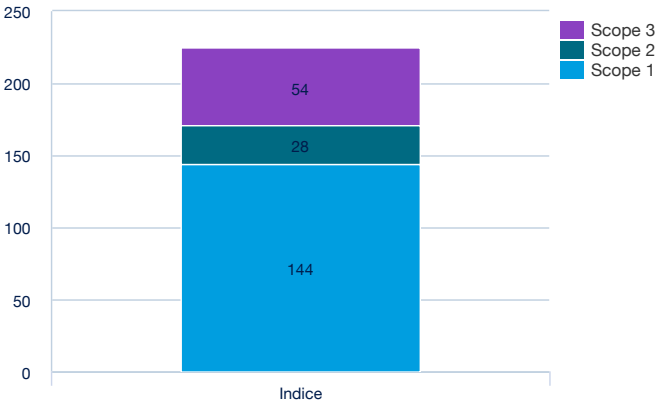
Evaluation par critère ESG (Source : Amundi)

	PTF	Critères ESG
Note Globale	7,45	Les critères sont des critères extra-financiers utilisés pour évaluer les pratiques environnementales, sociales et de gouvernance des entreprises.
Environnement	6,69	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 .
Social	5,08	
Gouvernance	6,56	
Indice parent :		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 tCO2 / M€ (Indice/Indice parent) : - 228,39



Indice parent :

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** : L'ensemble de toutes les autres émissions indirectes, en amont et en aval de la chaîne de valeur. Pour des raisons de robustesse des données, dans ce reporting nous faisons le choix de n'utiliser qu'une partie du scope 3 : les émissions amont liées aux fournisseurs de premier rang. Les fournisseurs de premier rang sont ceux avec lesquels l'entreprise a une relation privilégiée et sur lesquels elle peut directement influencer.

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.

Label ISR



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	07/12/2023
Date de la première VL	24/03/2014
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	Non applicable
Affectation des sommes distribuables	Distribution
Code ISIN	LU2611731667
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VNI	Quotidienne
Frais courants	0,30% (Estimés) - 04/10/2023
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	BNP Paribas

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Deutsche Börse	9:00 - 17:30	EUR	C007	C007 GY	CNAVC007	C007.DE	C007EURINAV=SOLA
Six Swiss Exchange	9:00 - 17:30	EUR	CBMDAX	CBMDAX SW	CNAVC007	CBMDAX.S	C007EURINAV=SOLA

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
UNITED KINGDOM (Retail)	+44 (0) 20 7 074 9598
UNITED KINGDOM (Insti)	+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@amundiETF.com

ACTION ■

Fournisseurs d'indices

STOXX et ses concédants de licence (les « Concédants ») n'ont aucune autre relation avec Amundi Asset Management que l'octroi de licence pour l'Indice MDAX ESG+ (NR) EUR Index® et les marques commerciales associées, à des fins d'utilisation en relation avec le Compartiment AMUNDI MDAX ESG.

STOXX et ses Concédants :

- Ne sponsorisent pas, n'avalisent pas, ne vendent pas et ne promeuvent pas le Compartiment AMUNDI MDAX ESG.
- Ne recommandent à personne d'investir dans le Compartiment AMUNDI MDAX ESG ni dans aucun autre titre.
- N'assument aucune responsabilité et ne prennent aucune décision concernant le calendrier, les montants et la valorisation du Compartiment AMUNDI MDAX ESG.
- N'assument aucune responsabilité quant à l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment AMUNDI MDAX ESG.
- Ne prennent aucunement en compte les besoins du Compartiment AMUNDI MDAX ESG ou des porteurs de parts du Compartiment AMUNDI MDAX ESG dans le cadre de la détermination, de la formulation ou du calcul de l'INDICE MDAX ESG+ (NR) EUR, et n'ont aucune obligation de le faire.

STOXX et ses Concédants n'assument aucune responsabilité en relation avec le Compartiment AMUNDI MDAX ESG. En particulier :

- STOXX et ses Concédants ne donnent aucune garantie, explicite ou implicite, et récusent toute garantie concernant :
 - Les résultats devant être obtenus par le Compartiment AMUNDI MDAX ESG, le porteur de parts du Compartiment AMUNDI MDAX ESG ou toute autre personne en rapport avec l'utilisation de l'INDICE MDAX ESG+ (NR) EUR et des données comprises dans l'INDICE MDAX ESG+ ;
 - L'exactitude ou l'exhaustivité de l'INDICE MDAX ESG et de ses données ;
 - La qualité marchande et l'adéquation à un usage particulier de l'INDICE MDAX ESG+ et de ses données ;
- STOXX et ses Concédants déclinent toute responsabilité en cas d'erreur, d'omission ou d'interruption de l'INDICE MDAX ESG+ ou de ses données ;
- STOXX et ses Concédants ne pourront en aucun cas être tenus responsables de quelconques profits non réalisés, dommages ou pertes indirects, punitifs, spéciaux ou consécutifs, quand bien même ils auraient été avisés de leur éventualité.

Le contrat de licence entre Amundi Asset Management et STOXX concerne uniquement ces derniers et aucunement les porteurs de parts du Compartiment AMUNDI MDAX ESG ou d'autres tierces parties.

Avertissement

Le Compartiment a été autorisé à la distribution à des investisseurs non qualifiés en et depuis la Suisse par la FINMA. Représentant : CACEIS Bank, Paris, Succursale de Nyon / Suisse, 35 route de Signy, 1260 Nyon, Suisse (anciennement « CACEIS Bank Luxembourg, Luxembourg, Succursale de Nyon », Suisse. Agent payeur : CA Indosuez (Suisse) S.A., 4 quai General Guisan, 1204 Genève. Les souscriptions ne seront acceptées que sur la base du Document d'Information Clé pour l'Investisseur (« DICl ») du compartiment considéré ainsi que du prospectus le plus récent de la SICAV, ses derniers rapports annuels et semestriels, ainsi que ses statuts, disponibles gratuitement au siège social de la SICAV ou auprès du représentant en Suisse. Les performances passées ne sont ni une assurance ni un indicateur fiable des rendements futures. La performance publiée ne tient pas compte des commissions et autres frais d'émission et de rachat de parts. 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.