

# Amundi CAC 40 ESG UCITS ETF

ACTIONS ■

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/07/2026

## Objectif d'investissement

Ce Compartiment est géré passivement. L'objectif de ce Compartiment est de répliquer la performance de l'Indice CAC 40 ESG et de minimiser l'écart de suivi entre la valeur nette des actifs du Compartiment et la performance de l'Indice. Le niveau prévu d'écart de suivi dans des conditions normales du marché est indiqué dans le prospectus du Compartiment. L'Indice est un Indice de rendement total net : les dividendes nets d'impôt payés par les composants de l'indice sont inclus dans le rendement de l'Indice. L'Indice est un indice d'actions basé sur le CAC 40, qui regroupe les 40 titres les plus importants et les plus activement négociés sur la Bourse de Paris (l'« Indice Parent »). L'Indice exclut certaines entreprises de l'Indice Parent sur la base de critères environnementaux, sociaux et de gouvernance, et vise une réduction minimale de 30 % de l'intensité des émissions de carbone par rapport à l'Indice Parent, ainsi qu'une amélioration de la note ESG et du ratio vert/brun. L'Indice applique des exclusions ciblant les sociétés impliquées dans des activités considérées comme non alignées sur l'Accord de Paris sur le climat (extraction de charbon, pétrole, etc.). Ces exclusions sont prévues à l'article 12, paragraphe 1, points a) à g), du règlement délégué (UE) 2020/1818 de la Commission du 17 juillet 2020 complétant le règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du Conseil par des normes minimales pour les indices de référence « transition climatique » de l'Union et les indices de référence « accord de Paris » de l'Union. Veuillez vous référer à la section « Directives concernant les dénominations des fonds contenant des termes liés aux critères ESG ou à la durabilité » du Prospectus. Les limites de l'approche adoptée sont décrites dans le prospectus du Compartiment par le biais de facteurs de risque tels que le risque d'investissement durable. Le score ESG des sociétés est calculé par une agence de notation ESG, à l'aide de données brutes, de modèles et d'estimations recueillies/calculées à l'aide de méthodes spécifiques à chaque fournisseur. En raison du manque de normalisation et du caractère unique de chaque méthodologie, les informations fournies peuvent être incomplètes. Il s'avère complexe d'évaluer les risques en matière de développement durable qui reposent sur des données ESG difficiles à obtenir, incomplètes, estimées, obsolètes et/ou sensiblement inexacts. Même lorsque ces données sont identifiées, rien ne permet de garantir qu'elles seront correctement évaluées. De plus amples informations sur la composition de l'indice et ses règles de fonctionnement sont disponibles dans le prospectus et à l'adresse : [euronext.com](https://euronext.com). La valeur de l'Indice est disponible via Bloomberg (CACESGRI). L'exposition à l'Indice sera obtenue par le biais d'une réplification directe, principalement en investissant directement dans des valeurs mobilières et/ou d'autres actifs éligibles représentant les composants de l'Indice dans une proportion extrêmement proche de leur proportion dans l'Indice. Le Gestionnaire d'investissement pourra utiliser des instruments dérivés afin de gérer les flux entrants et sortants et également si cela permet une meilleure exposition à un composant de l'Indice. Afin de générer des revenus supplémentaires pour compenser ses coûts, le Compartiment peut également conclure des opérations de prêt de titres.

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



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

| Depuis le    | Depuis le<br>31/12/2025 | 1 mois<br>30/06/2026 | 3 mois<br>30/04/2026 | 1 an<br>31/07/2025 | 3 ans<br>31/07/2023 | 5 ans<br>30/07/2021 | Depuis le<br>28/02/2003 |
|--------------|-------------------------|----------------------|----------------------|--------------------|---------------------|---------------------|-------------------------|
| Portefeuille | 4,46%                   | 0,33%                | 7,63%                | 9,50%              | 23,71%              | 47,82%              | 530,52%                 |
| Indice       | 3,90%                   | 0,33%                | 7,13%                | 8,94%              | 21,89%              | 44,13%              | 466,82%                 |
| Ecart        | 0,57%                   | 0,00%                | 0,50%                | 0,56%              | 1,82%               | 3,68%               | 63,70%                  |

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

|              | 2025   | 2024  | 2023   | 2022   | 2021   | 2020   | 2019   | 2018   | 2017   | 2016  |
|--------------|--------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| Portefeuille | 14,60% | 3,34% | 21,17% | -9,08% | 31,61% | -5,15% | 30,19% | -8,21% | 12,51% | 8,63% |
| Indice       | 14,06% | 2,82% | 20,55% | -9,54% | 31,07% | -5,57% | 29,24% | -8,88% | 11,69% | 7,67% |
| Ecart        | 0,54%  | 0,51% | 0,62%  | 0,46%  | 0,53%  | 0,42%  | 0,95%  | 0,67%  | 0,82%  | 0,96% |

\* Source : Amundi. Les performances nettes 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 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.

## Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

|                            | 1 an   | 3 ans  | Depuis le<br>lancement * |
|----------------------------|--------|--------|--------------------------|
| Volatilité du portefeuille | 15,87% | 15,31% | 19,89%                   |
| Volatilité de l'indice     | 15,87% | 15,31% | 19,90%                   |
| Tracking Error ex-post     | 0,25%  | 0,26%  | 0,26%                    |
| Ratio de sharpe            | 0,68   | 0,35   | 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

## Notation Morningstar ©

Notation Morningstar "Overall" © : **4 étoiles**

Catégorie Morningstar © :

**EAA FUND FRANCE EQUITY**

Date de notation : **30/06/2026**

Nombre de fonds de la catégorie : **209**

## ACTIONS ■

## 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.

Nous avons classé ce produit dans la catégorie de risque 4 sur 7, qui est une catégorie de risque moyenne. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau moyen et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est possible que notre capacité à vous payer en soit affectée. Risques supplémentaires : Le risque de liquidité du marché peut accentuer la variation des performances du produit. Ce produit ne prévoyant pas de protection contre les aléas de marché, vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement. Outre les risques inclus dans l'indicateur de risque, d'autres risques peuvent influencer sur la performance du Compartiment. Veuillez vous reporter au prospectus d'Amundi Index Solutions.

## Caractéristiques (source : Amundi)

|                                                                     |                                                      |
|---------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
| VL                                                                  | <b>C : 149,76 EUR</b><br><b>D : 86,79 EUR</b>        |
| Actif géré                                                          | <b>809,29 (millions EUR)</b>                         |
| Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation * | <b>0,25%</b>                                         |
| Date de la VNI                                                      | <b>31/07/2026</b>                                    |
| Code ISIN                                                           | <b>C : LU1681046931</b><br><b>D : LU1681047079</b>   |
| Type de Réplication                                                 | <b>Physique</b>                                      |
| Indice de référence                                                 | <b>100% CAC 40 ESG</b>                               |
| Affectation des sommes distribuables                                | <b>(C) Capitalisation</b><br><b>(D) Distribution</b> |
| Date du dernier coupon                                              | <b>09/12/2025 (EUR)</b>                              |
| Dernier dividende                                                   | <b>2,4000 (EUR)</b>                                  |
| Forme juridique                                                     | <b>SICAV de droit Luxembourgeois</b>                 |
| Norme européenne                                                    | <b>OPCVM</b>                                         |
| Société de gestion                                                  | <b>Amundi Luxembourg SA</b>                          |
| Teneur marché principal                                             | <b>BNP Paribas</b>                                   |
| Valorisateur                                                        | <b>CACEIS Bank, Luxembourg Branch</b>                |
| Dépositaire                                                         | <b>CACEIS Bank, Luxembourg Branch</b>                |
| Commissaire aux comptes                                             | <b>DELOITTE AUDIT</b>                                |
| Date de création de la classe                                       | <b>14/02/2018</b>                                    |
| Date de la première VL                                              | <b>28/02/2003</b>                                    |
| Devise de référence de la classe                                    | <b>EUR</b>                                           |
| Minimum de souscription marché secondaire                           | <b>1 Part(s)</b>                                     |
| Périodicité de calcul de la VNI                                     | <b>Quotidienne</b>                                   |
| Durée minimum d'investissement recommandée                          | <b>5 ans</b>                                         |
| Clôture fiscale                                                     | <b>Septembre</b>                                     |

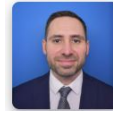
\* Pour plus d'informations concernant l'ensemble des coûts supportés par le fonds, veuillez vous référer à son Document d'Informations Clés (DIC). Des coûts de transaction et des commissions peuvent être appliqués dans le cadre de la négociation d'ETF.

## ACTIONS ■

## Rencontrez l'équipe

**Lionel Brafman**

Responsable Gestion Indicielle &amp; Multistratégie

**Isabelle Lafargue**Responsable Gestion Indicielle & Multistratégies –  
Fonds Régionaux**Christophe Neves**

Gérant suppléant

## 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)

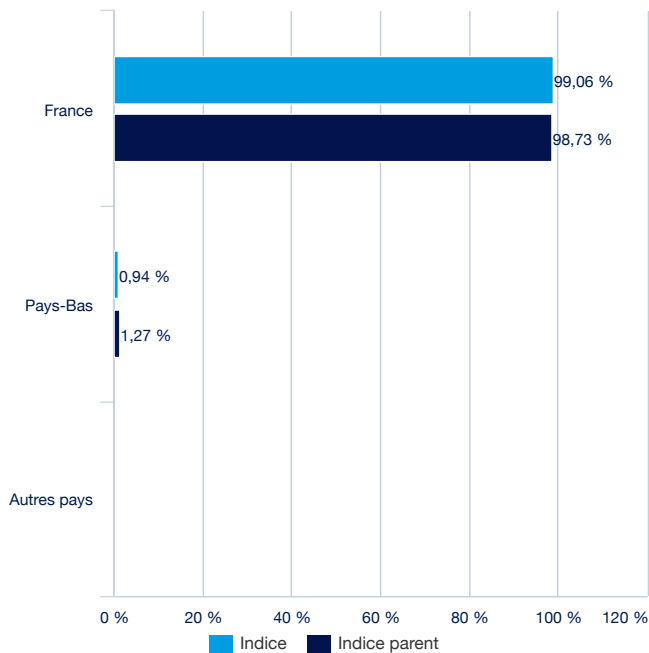
Classe d'actif : **Actions**Exposition : **Europe**Devise de référence de l'indice : **EUR**Nombre de valeurs : **39**

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

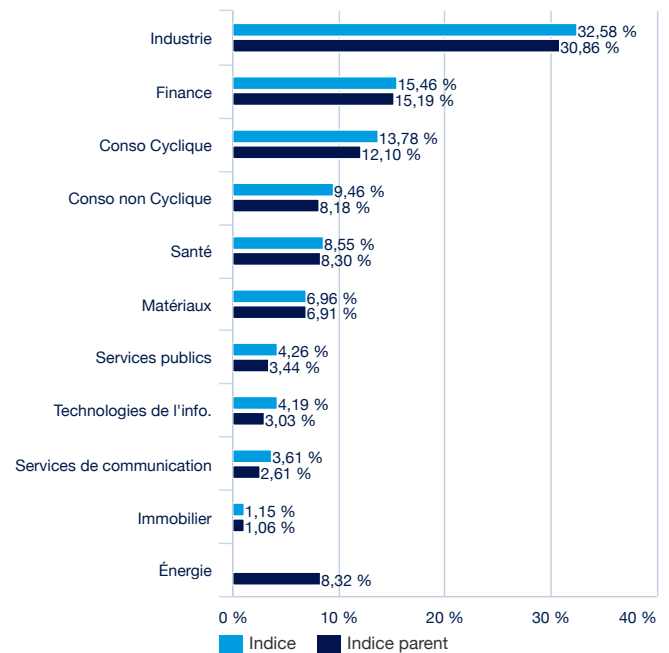
|                              | % d'actifs (indice) | % d'actifs (Indice parent) |
|------------------------------|---------------------|----------------------------|
| SCHNEIDER ELECT SE           | 9,78%               | 8,21%                      |
| AIRBUS SE PARIS              | 6,90%               | 6,06%                      |
| BNP PARIBAS                  | 6,68%               | 5,84%                      |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 6,65%               | 5,92%                      |
| AIR LIQUIDE SA               | 6,01%               | 5,46%                      |
| SAFRAN SA                    | 5,91%               | 5,40%                      |
| L OREAL (PARIS)              | 5,52%               | 4,73%                      |
| SANOFI - PARIS               | 5,27%               | 4,24%                      |
| AXA SA                       | 4,70%               | 4,17%                      |
| VINCI SA (PARIS)             | 3,64%               | 3,25%                      |
| <b>Total</b>                 | <b>61,08%</b>       | <b>53,28%</b>              |

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 | Indice parent |
|---------------|--------|---------------|
| Note Globale  | 7,33   | 7,35          |
| Environnement | 6,55   | 6,57          |
| Social        | 4,62   | 4,83          |
| Gouvernance   | 6,58   | 6,52          |

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)

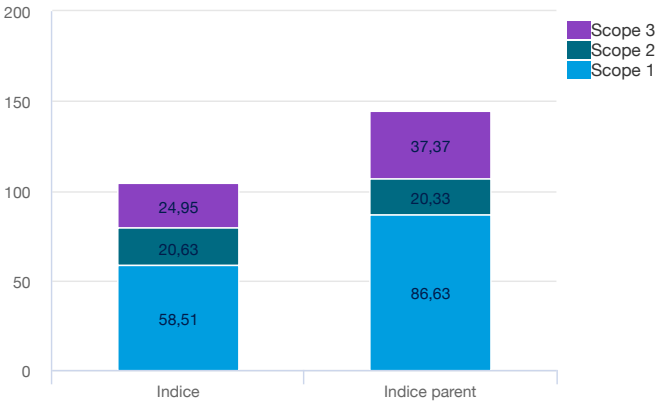
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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

Empreinte Carbone

Empreinte carbone par million d'euros investis

|                                             | Indice | Indice parent |
|---------------------------------------------|--------|---------------|
| Total en tCO2 / M€ (Indice/Indice parent) : | 104,09 | 144,33        |



Indice parent : CAC LARGE 60

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.

ACTIONS ■

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

| Place de cotation         | Devise | Ticker Bloomberg | iNAV Bloomberg | RIC Reuters | iNAV Reuters |
|---------------------------|--------|------------------|----------------|-------------|--------------|
| Six Swiss Exchange        | EUR    | C40 SW           | INC40          | C40.S       | INC40=BNPP   |
| Deutsche Boerse (Xetra)   | EUR    | GC40 GY          | INC40          | GC40.DE     | INC40=BNPP   |
| Euronext Paris            | EUR    | C40 FP           | INC40          | C40.PA      | INC40=BNPP   |
| Bolsa Mexicana de Valores | MXN    | C40N MM          | -              | -           | -            |
| Euronext Milan            | EUR    | C40 IM           | INC40          | C40.MI      | INC40=BNPP   |

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 (Retail) | +44 (0) 20 7 074 9598 |
| Royaume-Uni (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****Mentions relatives à la société de gestion et au fonds**

Compartiment de la SICAV luxembourgeoise Amundi Index Solutions (le "Compartiment" ou le "Fonds" et la "SICAV"). La SICAV est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières existant en vertu de la partie I de la loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010, organisée sous la forme d'une société d'investissement à capital variable et immatriculée au Registre de Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le numéro B206810. La SICAV a son siège social au 5, allée Scheffer, L-2520 Luxembourg. Le Compartiment a été autorisé à la vente au public par la Commission de Surveillance du Secteur Financier du Luxembourg et en France par l'AMF. La SICAV a d'autres compartiments qui sont décrits dans le prospectus. Tous les compartiments ne seront pas nécessairement enregistrés ou autorisés à la vente dans les juridictions de tous les investisseurs.

Le Fonds est décrit dans un Document d'informations clés (DIC) et dans un prospectus. Le DIC (ou KID) doit être mis à la disposition des souscripteurs potentiels avant la souscription.

Le prospectus en français pour les ETF UCITS français, et en anglais pour les ETF UCITS luxembourgeois et les ETF irlandais, ainsi que le KID en français sont disponibles gratuitement sur [www.amundi.com](http://www.amundi.com), [www.amundiETF.com](http://www.amundiETF.com). Ils sont également disponibles au siège d'Amundi Luxembourg S.A. (en tant que société de gestion d'Amundi Index Solutions et de Multi Units Luxembourg), ou au siège d'Amundi Asset Management (en tant que société de gestion de Multi Units France), ou au siège d'Amundi Ireland Limited (en tant que société de gestion d'Amundi ETF ICAV et d'Amundi ETF II ICAV).

S'agissant des Fonds admis sur un marché réglementé, la cotation est soumise à un mécanisme d'encadrement permettant de s'assurer que le cours des actions ou parts ne s'écarte pas sensiblement d'une valeur de référence fixée par les règles du marché réglementé en question, notamment par la mise en place d'un dispositif de réservation de la cotation en cas d'écart trop important par rapport à cette valeur de référence.

Le Fonds n'offre aucune garantie de capital. L'investisseur peut ne pas récupérer l'intégralité de son investissement initial, notamment en cas de baisse de l'indice de référence. La souscription à un OPCVM peut comporter des risques. Les investisseurs potentiels sont invités à lire le profil de risque du Fonds, qui est décrit en détail dans le prospectus. Le montant qu'il est raisonnable d'investir dans le Fonds dépendra de la situation personnelle de chaque investisseur. Pour déterminer ce montant, l'investisseur doit tenir compte de sa situation financière, de son patrimoine personnel, de ses besoins actuels et futurs, ainsi que de sa volonté d'accepter des risques ou au contraire de sa préférence à investir avec prudence. Il est également fortement recommandé aux investisseurs de diversifier suffisamment leurs investissements afin d'éviter de s'exposer uniquement aux risques de ce FCP. L'investisseur est donc invité à se renseigner à ce sujet auprès de ses conseils habituels (juridique, fiscal, financier et/ou comptable) avant toute acquisition de parts du FCP.

La source des données contenues dans ce document est Amundi Asset Management sauf mention contraire.

**Politique de transparence du portefeuille et avertissement sur le marché secondaire**

La politique de transparence du portefeuille et les informations sur les actifs du fonds sont disponibles sur [amundiETF.com](http://amundiETF.com). Les actions achetées sur le marché secondaire ne peuvent généralement pas être revendues directement au fonds. Les investisseurs doivent acheter et vendre des actions sur un marché secondaire avec l'aide d'un intermédiaire (par exemple un courtier en valeurs mobilières) et peuvent encourir des frais pour cela. Les investisseurs peuvent payer plus que la valeur liquidative actuelle lorsqu'ils achètent des actions et peuvent recevoir moins que la valeur liquidative actuelle lorsqu'ils les vendent.

*« Les valeurs liquidatives techniques peuvent être calculées et publiées tout jour civil (à l'exception des samedis et des dimanches) qui ne soit ni un jour ouvré ni un jour de transaction. Ces valeurs liquidatives techniques n'ont qu'une valeur indicative et ne serviront pas de base pour l'achat, la conversion, le rachat et/ou le transfert d'actions. »*