

INFORMATIONS
SEMESTRIELLES
DÉCEMBRE 2023

AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

OPCVM de droit français

Société de gestion

Amundi Asset Management

Sous déléguataire de gestion comptable en titre

CACEIS Fund Administration France

Dépositaire

CACEIS BANK

Commissaire aux comptes

PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Sommaire

	Pages
Caractéristiques de l'OPC	3
Compte rendu d'activité	9
Vie de l'OPC sur l'exercice sous revue	14
Informations spécifiques	15
Attestation du commissaire aux comptes	16
Portefeuille Titres Détaillé	17

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Caractéristiques de l'OPC

Classification

Actions internationales.

Le Fonds est un fonds indiciel.

Modalité de détermination et d'affectation des sommes distribuables

Capitalisation et/ou distribution par décision de la Société de Gestion.

Régime fiscal

Le Fonds est éligible au contrat d'assurance vie. Le Fonds pourra donc servir de support de contrat d'assurance vie libellé en unités de compte.

L'OPCVM en tant que tel n'est pas sujet à imposition. Toutefois, les porteurs peuvent supporter des impositions du fait des revenus distribués par l'OPCVM, le cas échéant, ou lorsqu'ils cèderont les titres de celui-ci. Le régime fiscal applicable aux sommes distribuées par l'OPCVM ou aux plus ou moins-values latentes ou réalisées par l'OPCVM dépend des dispositions fiscales applicables à la situation particulière de l'investisseur, de sa résidence fiscale et/ou de la juridiction d'investissement de l'OPCVM. Si l'investisseur n'est pas sûr de sa situation fiscale, il doit s'adresser à un conseiller fiscal ou un professionnel afin de déterminer les règles fiscales applicables à sa situation particulière, avant tout investissement. Certains revenus distribués par l'OPCVM à des non-résidents en France sont susceptibles de supporter dans cet Etat une retenue à la source.

Indicateur de référence

L'indicateur de référence du fonds est l'indice Bloomberg Hydrogen ESG Index (l'« **Indice** »), libellé en USD, dividendes nets réinvestis (la performance de l'Indice inclut les dividendes nets détachés par les actions qui le composent). L'Indice est un indice action calculé et publié par le fournisseur d'indices international Bloomberg Index Services Limited (« **Bloomberg** »).

L'Indice a pour objectif de refléter la performance des entreprises exposées à la production d'hydrogène, d'équipements ou de technologies visant à produire ou à supporter la production ou l'utilisation d'hydrogène ainsi que des produits dédiés à cette thématique (ci-après la « **Thématique** »), tout en visant à satisfaire certaines exigences environnementales, sociales et de gouvernance (« **ESG** »).

Frais et commissions de gestion

Frais de fonctionnement et de gestion : 0,45% TTC.

Commission de souscription acquise au Fonds : 1%.

Conformément à la réglementation et au cours de l'exercice écoulé, cet OPCVM a présenté en pratique des taux conformes à ceux mentionnés dans le prospectus et repris les rubriques :

- Annexes aux comptes annuels/- Frais de Gestion.

- Capitaux propres/- Commissions de souscription et/ou rachat/Frais de gestion.

Objectif de gestion

L'objectif de gestion du Fonds est de répliquer, le plus fidèlement possible, la performance de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index (cf. section « **Indicateur de Référence** »), quelle que soit son évolution, positive ou négative.

La gestion vise à obtenir un écart entre l'évolution de la valeur liquidative du Fonds et celle de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index (ci-après « **l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index** ») contre valorisé en euro le plus faible possible. Ainsi, l'objectif d'écart de suivi (« **tracking error** ») maximal entre l'évolution de la valeur liquidative du Fonds et celle de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index contrevalorisé en euro est de 2%.

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Si la tracking error, devenait malgré tout plus élevé que 2%, l'objectif serait de rester néanmoins à un niveau inférieur à 15% de la volatilité de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index contrevalorisé en euro.

Stratégie d'investissement

La gestion du Fonds est de type « passive ».

1. Stratégie utilisée :

L'OPC est classé article 8 au sens du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « **Règlement Disclosure** »). Des informations sur les caractéristiques environnementales et sociales sont disponibles en annexe de ce prospectus.

Les principales incidences négatives des décisions d'investissement (au sens du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « Règlement Disclosure »)) sont les effets négatifs, importants ou susceptibles d'être importants, sur les facteurs de durabilité qui sont causés, aggravés par ou directement liés aux décisions d'investissement. L'Annexe 1 du règlement délégué au Règlement Disclosure dresse la liste des indicateurs des principales incidences négatives.

Les principales incidences négatives obligatoires de l'Annexe 1 du règlement délégué sont prises en compte dans la stratégie d'investissement via une combinaison d'exclusions (normatives et sectorielles), d'intégration de la notation ESG dans le process d'investissement, d'engagement et de vote.

Des informations plus détaillées sur les principales incidences négatives sont incluses dans la déclaration réglementaire ESG de la Société de Gestion disponible sur son site internet : www.amundi.com.

Conformément à son objectif et à sa politique d'investissement, l'OPC peut investir dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental au sens de l'article 5 du Règlement sur la Taxonomie. Aussi, il est attendu que l'OPC puisse partiellement investir dans des activités économiques qualifiées d'écologiquement durables au sens des articles 3 et 9 du Règlement sur la Taxonomie. L'OPC ne prend toutefois actuellement aucun engagement quant à une proportion minimale.

Le Fonds fait l'objet d'une gestion indicielle dont l'objectif est de répliquer les évolutions de la performance de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index selon une méthode de réplification directe de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index qui consiste à investir dans les titres financiers entrant dans la composition de l'Indice dans des proportions extrêmement proches de celles de l'Indice.

Le Fonds pourra avoir recours à des techniques de gestion efficace de portefeuille en conformité avec les dispositions de l'article R214-18 du CMF et notamment des opérations de cession temporaire de titres financiers, dans les conditions présentées ci-après.

La Société de Gestion pourra décider d'utiliser la technique dite par « échantillonnage » consistant à investir dans une sélection de titres représentatifs composant l'Indice (et non tous les titres), dans des proportions différentes de celles de l'Indice ou bien même à investir dans des titres n'entrant pas dans la composition de l'Indice.

Par ailleurs, le Fonds intègre des facteurs de durabilité dans son processus d'investissement. En effet, Amundi applique une Politique d'Investissement Responsable qui consiste d'une part en une politique d'exclusions ciblées selon la stratégie d'investissement et d'autre part en un système de notations ESG mis à la disposition de l'équipe de gestion (le détail de cette politique est disponible dans la Politique Investissement Responsable d'Amundi disponible sur le site www.amundi.fr).

Le Fonds respectera les règles d'investissements édictées aux articles R214-21, R214-22 et R214-23 du CMF.

L'actif du Fonds composé des actifs détenus directement et décrits dans la rubrique « Actifs utilisés » respecte les dispositions de l'article R214-21 du CMF.

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

L'exposition du Fonds à l'indice peut bénéficier des ratios dérogatoires applicables aux OPCVM indiciels mentionnés à l'article R214-22 du CMF. Cet article dispose que l'indice peut être composé jusqu'à hauteur de 20% maximum d'actions ou de titres de créance émis par une même entité, cette limite pouvant être portée à 35% maximum pour une seule entité émettrice lorsque cela se révèle justifié par des conditions exceptionnelles sur le marché, notamment sur des marchés réglementés où certaines valeurs mobilières ou certains instruments du marché monétaire sont largement dominants.

2. Actifs utilisés (hors dérivés intégrés) :

Le Fonds sera en permanence investi à hauteur de 60% au moins en actions cotées. Aux fins d'interprétation de ce ratio, les actions émises par des REITs (tel que ce terme est défini par le ministère allemand des finances) ou des OPC ne sont pas considérées comme des actions.

Titres de créances, et instruments du marché monétaire libellés en euro :

La gestion de la trésorerie est effectuée à travers la détention d'instruments du marché monétaire.

Les titres en portefeuille seront sélectionnés selon le jugement de la gestion et dans le respect de la politique interne de suivi du risque de crédit de la Société de Gestion.

En vue de la sélection des titres, la gestion ne s'appuie, ni exclusivement ni mécaniquement, sur les notations émises par les agences de notation, mais fonde sa conviction d'achat et de vente d'un titre sur ses propres analyses de crédit et de marchés. A titre d'information, la gestion pourra recourir notamment à des titres bénéficiant des notations minimales de AA dans l'échelle S&P et Moody's.

Les émetteurs sélectionnés pourront aussi bien relever du secteur privé que du secteur public (Etats, collectivités territoriales), les dettes privées étant susceptibles de représenter jusqu'à 100% des instruments de dette. La durée moyenne de ces instruments sera inférieure à 10 ans.

Parts ou actions d'OPCVM :

Le Fonds peut détenir jusqu'à 10% de son actif en parts et/ou actions d'OPCVM. Ces OPCVM sont représentatifs de toutes les classes d'actifs, dans le respect des contraintes du Fonds.

Il peut s'agir d'OPCVM gérés par la Société de Gestion ou par d'autres entités appartenant ou non au Groupe Crédit Agricole SA - y compris une société liée.

3. Instruments dérivés :

La sélection des contreparties est effectuée selon la procédure en vigueur au sein d'Amundi et repose sur le principe de sélectivité des meilleures contreparties de marché.

Ceci se traduit notamment par :

une double validation des contreparties par le responsable d'Amundi Intermédiation et par le Comité Crédit d'Amundi Asset Management après analyse de leurs profils financiers et opérationnels (nature d'activités, gouvernance, réputation, etc.) par une équipe d'analystes crédit indépendante des équipes de gestion. un nombre limité d'institutions financières avec lesquelles l'OPCVM négocie.

Amundi AM s'appuie sur l'expertise d'Amundi Intermédiation dans le cadre d'une prestation de service quant à la sélection des contreparties.

Amundi Intermédiation propose à Amundi AM une liste indicative de contreparties, dont l'éligibilité a préalablement été validée par le Comité Risque de Crédit d'Amundi (groupe), sur les aspects de risque de contreparties.

Cette liste est validée ensuite par Amundi AM lors de comités ad-hoc, « Comités Broker ». Les Comités Broker ont pour objet :

- de suivre les volumes (courtages sur les actions et montant net pour les autres produits) par intermédiaire / contrepartie, par type d'instrument et par marché le cas échéant ;
- de se prononcer sur la qualité de la prestation de table de négociation d'Amundi Intermédiation ;

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

- d'effectuer la revue des courtiers et contreparties, et d'en arrêter la liste pour la période à venir. Amundi AM peut décider de restreindre la liste, ou demander de l'élargir. Toute proposition d'élargissement de la liste des contreparties par Amundi AM lors d'un comité, ou ultérieurement, est alors à nouveau soumise à l'analyse et l'approbation du Comité Risque de Crédit d'Amundi.

Les Comités Broker d'Amundi AM rassemblent les Directeurs de Gestion ou leurs représentants, les représentants de la table de négociation d'Amundi Intermédiation, un responsable des opérations, un responsable du Contrôle des Risques, ainsi qu'un responsable de la Conformité.

4. Titres intégrant des dérivés :

Néant.

5. Dépôts et liquidités :

Le Fonds peut, dans la limite de 20% de son actif net effectuer des dépôts d'une durée maximale de douze mois. Ces dépôts contribuent à la réalisation de l'objectif de gestion du Fonds en lui permettant de gérer la trésorerie.

6. Emprunt d'espèces :

De manière exceptionnelle et temporaire, le Fonds pourra avoir recours, dans la limite de 10% de son actif net, à des emprunts, en vue d'optimiser la gestion de sa trésorerie.

7. Opérations d'acquisitions et de cessions temporaires de titres :

Nature des opérations utilisées :

- prises et mises en pension par référence au Code monétaire et financier
- prêts et emprunts de titres par référence au Code monétaire et financier
- autre nature : sell and buy back ; buy and sell back

Nature des interventions, l'ensemble des opérations devant être limitées à la réalisation de l'objectif de gestion:

- gestion de la trésorerie
- optimisation des revenus de l'OPCVM
- contribution éventuelle à l'effet de levier de l'OPCVM
- autre nature

Ces opérations porteront sur l'ensemble des actifs autorisés tels que décrits au point 2. « Actifs de bilan (hors dérivés intégrés) », hors OPC et fonds d'investissement.

Niveau d'utilisation envisagé et autorisé :

Les proportions maximales et attendues d'actifs sous gestion qui feront l'objet de telles opérations sont décrites ci-après.

- Proportion maximum de l'actif net
 - Pour les opérations de prêts de titre : 45%
 - Pour les opérations d'emprunt de titre: 0%
- Proportion attendue de l'actif net :
 - Pour les opérations de prêts de titre : 0%
 - Pour les opérations d'emprunt de titre: 0%

La somme de l'exposition issue des titres vifs et des engagements aux dérivés, aux titres intégrant des dérivés et aux opérations d'acquisition et cession temporaire de titres est limitée à 100% de l'actif net.

Dans les opérations de prêt et d'emprunt de titres, un prêteur transfère des titres ou des instruments à un emprunteur, sous réserve de l'engagement de l'emprunteur de restituer des titres ou instruments équivalents à une date ultérieure ou à la demande du prêteur.

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Le Fonds peut prêter des titres en portefeuille soit directement, soit par l'intermédiaire de l'un des moyens suivants :

- un système de prêt standardisé organisé par un organisme de compensation reconnu ; ou/et
- un système de prêt organisé par une institution financière spécialisée dans ce type d'opérations.

L'emprunteur doit fournir du collatéral sur toute la durée du prêt et qui est au moins égale à l'évaluation globale des titres prêtés, majorée de la valeur de toute décote (cf. paragraphe 8 ci-dessous) jugée appropriée compte tenu de la qualité du collatéral. Le Fonds ne peut emprunter des titres que dans des circonstances exceptionnelles, telles que :

- lorsque les titres qui ont été prêtés ne sont pas restitués à temps ; ou
- lorsque, pour une raison externe, le Fonds n'a pas pu livrer les titres alors qu'il était tenu de le faire.

Informations relatives aux garanties financières (acquisition et cessions temporaires de titres) et aux contrats d'échange sur rendement global (TRS)

Nature des garanties financières :

Dans le cadre des opérations d'acquisitions et cessions temporaires de titres et des opérations sur dérivés négociés de gré à gré, le Fonds peut recevoir à titre de garantie (appelé collatéral) des titres et des espèces.

Des décotes peuvent être appliquées au collatéral reçu ; elles prennent en compte notamment la nature, la maturité, la qualité de crédit et la devise ainsi que la volatilité des prix des titres et le résultat des simulations de crises réalisées.

Les titres reçus en garantie doivent respecter des critères définis par la Société de Gestion. Ils doivent être :

- liquides,
- cessibles à tout moment,
- diversifiés dans le respect des règles d'éligibilité, d'exposition et de diversification de l'OPCVM,
- émis par un émetteur qui n'est pas une entité de la contrepartie ou de son groupe.

Pour les obligations, les titres seront en outre émis par des émetteurs localisés dans l'OCDE et de haute qualité dont la notation minimale pourrait aller de AAA à BBB- sur l'échelle de Standard & Poor's ou bénéficiant d'une notation jugée équivalente par la société de gestion. Les titres obligataires doivent avoir une échéance maximale de 50 ans.

Les critères décrits ci-dessus sont détaillés dans une politique Risques consultable sur le site internet de la Société de Gestion : www.amundi.com et pourront faire l'objet de modifications notamment en cas de circonstances de marché exceptionnelles.

Des décotes peuvent être appliquées au collatéral reçu ; elles prennent en compte la qualité de crédit, la volatilité des prix des titres ainsi que le résultat des simulations de crises réalisées.

Réutilisation du collatéral espèces reçu : Le collatéral espèces reçu peut être réinvesti en dépôts, en obligations d'Etat, en opérations de prises en pension ou en OPCVM monétaires court terme conformément à la Politique Risques de la Société de Gestion.

Réutilisation du collatéral titres reçu :

Non autorisé : Les titres reçus en garantie ne peuvent être vendus, réinvestis ou remis en garantie.

Profil de risque

Risque actions

Risque de contrepartie

Risque lié à l'utilisation de techniques efficaces de gestion de portefeuille

Risque de liquidité lié aux acquisitions et cessions temporaires de titres et/ou contrats d'échange sur rendement global (TRS)

Risques liés à la gestion des garanties

Risque que l'objectif de gestion ne soit que partiellement atteint

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Risque lié aux évolutions de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index

Facteurs susceptibles d'influencer la capacité du Fonds à répliquer la performance de l'Indice Bloomberg Hydrogen ESG Index

Risque sectoriel

Risque de crédit

Risque lié à l'investissement sur des Marchés émergents

Risque juridique

Risque de change

Risque de liquidité

Risque de liquidité sur une place de cotation

Risque en matière de durabilité

Risque lié aux méthodologies ESG

Risque de marché lié aux controverses

Risque lié à la computation des scores ESG

Risque de calcul de l'Indice

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Compte rendu d'activité

Le fonds a pour objectif d'obtenir une performance identique à celle de l'indice MSCI Europe Energy tout en conservant son éligibilité au PEA, c'est-à-dire qu'il prend l'engagement de détenir en permanence 75% de son actif en actions éligibles au PEA. Il possède donc un panier d'actions et un swap de performance qui permet d'échanger la performance des actions contre la performance de l'indice MSCI Europe Energy.

Sur la période sous revue du portefeuille AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF, la performance est de 15,67%. Celle du benchmark est de 15,94%.

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

Principaux mouvements dans le portefeuille au cours de l'exercice

Titres	Mouvements ("Devise de comptabilité")	
	Acquisitions	Cessions
MICROSOFT CORP	4 085 578,58	5 226 400,92
APPLE INC	2 918 003,74	4 079 815,36
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	2 732 788,25	3 744 529,52
NOVARTIS AG-REG	1 759 458,02	4 219 943,09
ALPHABET- A	1 355 484,66	3 782 851,12
LINDE PLC	3 041 588,79	1 592 183,37
MICRON TECHNOLOGY INC	2 188 420,97	2 391 179,47
ASR NEDERLAND NV	1 640 669,94	2 772 013,60
HUMANA INC	2 109 420,60	2 279 965,84
HERSHEY FOODS CORP	1 740 765,43	2 571 869,11

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers - Règlement SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

a) Titres et matières premières prêtés

Montant	1 560 998,22				
% de l'Actif Net*	5,10%				

*% hors trésorerie et équivalent de trésorerie

b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

Montant	1 560 998,22				
% de l'Actif Net	5,10%				

c) 10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors cash) pour tous les types d'opérations de financement

--	--	--	--	--	--

d) 10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation

GOLDMAN SACHS BANK EUROPE SE ALLEMAGNE	1 560 998,22				
--	--------------	--	--	--	--

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash	1 698 298,00				
Rating					
Monnaie de la garantie					
Euro	1 698 298,00				

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties			X	
Contrepartie centrale				
Bilatéraux	X		X	

g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour				
1 jour à 1 semaine				
1 semaine à 1 mois				
1 à 3 mois				
3 mois à 1 an				
Plus d'1 an				
Ouvertes				

h) Échéance des opérations de financement sur titres et TRS ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour				
1 jour à 1 semaine				
1 semaine à 1 mois				
1 à 3 mois				
3 mois à 1 an				
Plus d'1 an				
Ouvertes	1 560 998,22			

i) Données sur la réutilisation des garanties

Montant maximal (%)				
Montant utilisé (%)				
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros				

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

Caceis Bank				
Titres				
Cash	1 698 298,00			

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Titres				
Cash				

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus				
- OPC	50,00			
- Gestionnaire				
- Tiers				
Coûts				
- OPC				
- Gestionnaire				
- Tiers				

e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

Amundi Asset Management veille à n'accepter que des titres d'une haute qualité de crédit et veille à rehausser la valeur de ses garanties en appliquant des décotes de valorisation sur les titres reçus. Ce dispositif est régulièrement revu et remis à jour.

i) Données sur la réutilisation des garanties

« La réglementation applicable aux OPCVM interdit la réutilisation par ce dernier des garanties reçues en titres. Les garanties reçues en espèces sont réinvesties dans les 5 supports suivants :

- o OPCVM monétaires court terme (tels que définis par l'ESMA dans ses orientations sur les fonds cotés et autres questions liées aux OPCVM)
- o Dépôt
- o Titres d'Etats Long Terme de haute qualité
- o Titres d'Etats Court Terme de haute qualité
- o Prises en pension »

Le montant maximal de réutilisation est de 0% pour les titres et 100% du montant reçu pour les espèces. Le montant utilisé est de 0% pour les titres et 100% pour les espèces reçus.

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Amundi Asset Management veille à travailler avec un nombre réduit de dépositaires, sélectionnés pour s'assurer de la bonne conservation des titres reçus et du cash.

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

I) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Opérations de prêts de titres et de mise en pension :

Dans le cadre des opérations de prêts de titres et de mise en pension, Amundi Asset Management a confié à Amundi Intermédiation, pour le compte de l'OPCVM, les réalisations suivantes : la sélection des contreparties, la demande de mise en place des contrats de marché, le contrôle du risque de contrepartie, le suivi qualitatif et quantitatif de la collatéralisation (contrôles de dispersion, des notations, des liquidités), des pensions et prêts de titres. Les revenus résultant de ces opérations sont restitués à l'OPCVM. Ces opérations engendrent des coûts qui sont supportés par l'OPCVM.

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Vie de l'OPC sur l'exercice sous revue

Néant.

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Informations spécifiques

Droit de vote

Conformément à la politique que la société de gestion s'est fixée et conformément au règlement du Fonds, la société de gestion exerce les droits de vote attachés aux valeurs inscrites à l'actif du Fonds et décide de l'apport des titres, à l'exception des titres de l'entreprise ou de toute entreprise qui lui est liée dans les conditions prévues à l'article L.444-3 du Code du travail.

Les documents intitulés « Politique de vote » et « Rapport d'exercice des droits de vote » élaborés par la société de gestion conformément à la réglementation sont disponibles sur demande. Le présent OPCVM n'a pas été retenu dans la liste des fonds qui votent actuellement.

Soft commissions

La société de gestion n'a pas perçu de Commissions de Mouvements.

Commission en nature

La société de gestion n'a pas perçu de Commissions en Nature.

Utilisation Dérivés de crédit

Le FCP n'a pas utilisé sur l'exercice de Dérivés de Crédit.

Fonds du groupe

Afin de prendre connaissance de l'information sur les instruments financiers détenus en portefeuille qui sont émis par la Société de Gestion ou par les entités de son groupe, veuillez-vous reporter aux rubriques des comptes annuels :

- Autres Informations.
- Instruments financiers détenus, émis et/ou gérés par le groupe.

Calcul du risque global

• Méthode de calcul du risque global : L'OPC utilise la méthode du calcul de l'engagement pour calculer le risque global de l'OPC sur les contrats financiers.



ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 29 décembre 2023

AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF
OPCVM CONSTITUE SOUS FORME DE FONDS COMMUN DE PLACEMENT
Régi par le Code monétaire et financier

Société de gestion
AMUNDI ASSET MANAGEMENT
90, boulevard Pasteur
75015 PARIS

En notre qualité de commissaire aux comptes de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF, et en application des dispositions de l'article L.214-17 du Code monétaire et financier et de l'article 411-125 du Règlement général de l'Autorité des marchés financiers relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif au 29 décembre 2023 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette mission. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique

Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit
Raphaëlle Alezra-Cabessa

2024.02.13 11:14:27 +0100

PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
SIEMENS ENERGY AG	EUR	4 413	52 956,00	0,17
TOTAL ALLEMAGNE			52 956,00	0,17
AUSTRALIE				
FORTESCUE METALS GROUP	AUD	101 912	1 826 849,24	5,96
TOTAL AUSTRALIE			1 826 849,24	5,96
CANADA				
BALLARD POWER SYSTEMS	CAD	33 786	113 888,00	0,37
METHANEX	CAD	10 708	460 783,63	1,51
TOTAL CANADA			574 671,63	1,88
CHINE				
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	CNY	79 300	886 588,25	2,90
WEICHAJ POWER CO LTD-A	CNY	397 841	693 164,72	2,26
TOTAL CHINE			1 579 752,97	5,16
COREE DU SUD				
DOOSAN FUEL CELL CO LTD	KRW	4 616	75 274,33	0,25
LG CHEMICAL	KRW	4 369	1 532 412,66	5,01
TOTAL COREE DU SUD			1 607 686,99	5,26
DANEMARK				
ORSTED	DKK	25 720	1 291 425,51	4,22
TOTAL DANEMARK			1 291 425,51	4,22
ESPAGNE				
ENDESA SA	EUR	40 773	752 669,58	2,46
IBERDROLA SA	EUR	141 197	1 676 008,39	5,48
TOTAL ESPAGNE			2 428 677,97	7,94
ETATS-UNIS				
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	USD	6 181	1 532 030,78	5,00
BLOOM ENERGY CORP- A	USD	25 683	344 098,49	1,13
CUMMINS INC	USD	7 504	1 627 423,42	5,32
DOVER CORP	USD	6 047	841 976,25	2,75
FuelCell Energy --- Registered Shs	USD	57 899	83 862,22	0,27
GENERAL ELECTRIC CO	USD	7 002	809 003,09	2,65
HYSTER-YALE MATERIALS	USD	1 223	68 852,91	0,22
NIKOLA CORP	USD	95 613	75 718,33	0,25
PLUG POWER INC	USD	83 659	340 800,71	1,11
TOTAL ETATS-UNIS			5 723 766,20	18,70
FRANCE				
AIR LIQUIDE	EUR	9 258	1 630 518,96	5,32
ALSTOM	EUR	12 965	157 913,70	0,52
ENGIE	EUR	100 524	1 600 141,03	5,23

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Portefeuille titres détaillé en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NEOEN SA	EUR	11 725	355 033,00	1,16
TOTAL FRANCE			3 743 606,69	12,23
ITALIE				
ENEL SPA	EUR	120 592	811 584,16	2,65
INDUSTRIE DE NORA SPA	EUR	8 890	139 484,10	0,46
TOTAL ITALIE			951 068,26	3,11
JAPON				
IHI CORP	JPY	20 200	358 125,79	1,17
MITSUBISHI HVY IND JPY50	JPY	30 400	1 608 686,12	5,26
TOYOTA MOTOR	JPY	46 500	773 489,40	2,53
TOTAL JAPON			2 740 301,31	8,96
NORVEGE				
NEL ASA	NOK	93 357	57 336,52	0,19
NORSK HYDRO ASA	NOK	152 187	927 895,07	3,03
SCATEC SOLAR	NOK	15 575	114 051,46	0,38
YARA INTERNATIONAL	NOK	24 937	802 892,04	2,62
TOTAL NORVEGE			1 902 175,09	6,22
PAYS-BAS				
OCI NV REG	EUR	10	262,40	
TOTAL PAYS-BAS			262,40	
ROYAUME-UNI				
JOHNSON MATTHEY PLC	GBP	28 824	564 638,39	1,84
LINDE PLC	USD	4 226	1 571 231,12	5,13
NATIONAL GRID PLC	GBP	65 063	794 376,02	2,60
TOTAL ROYAUME-UNI			2 930 245,53	9,57
SUEDE				
ALFA LAVAL	SEK	22 631	820 062,47	2,68
SSAB SVENSKT STAL S.A LIBRE	SEK	123 158	848 305,00	2,77
TOTAL SUEDE			1 668 367,47	5,45
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			29 021 813,26	94,83
TOTAL Actions et valeurs assimilées			29 021 813,26	94,83
Créance représentative de titres prêtés				
ALLEMAGNE				
SIEMENS ENERGY AG	EUR	70 300	843 600,00	2,76
TOTAL ALLEMAGNE			843 600,00	2,76
FRANCE				
ALSTOM	EUR	32 343	393 937,74	1,28
TOTAL FRANCE			393 937,74	1,28
PAYS-BAS				
OCI NV REG	EUR	12 327	323 460,48	1,06
TOTAL PAYS-BAS			323 460,48	1,06
TOTAL Créance représentative de titres prêtés			1 560 998,22	5,10

OPCVM AMUNDI GLOBAL HYDROGEN ESG SCREENED UCITS ETF

Portefeuille titres détaillé en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Indemnités sur titres prêtés			-4 528,96	-0,02
Créances			49 308,00	0,16
Dettes			-1 739 503,04	-5,68
Comptes financiers			1 716 699,93	5,61
Actif net			30 604 787,41	100,00

Amundi Asset Management, Société par actions Simplifiée - SAS au capital de 1 143 615 555 €.
Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 04 000 036.
Sièges social : 91-93 boulevard Pasteur - 75015 Paris - France - 437 574 452 RCS Paris - www.amundi.com

Amundi
ASSET MANAGEMENT