

# AMUNDI MSCI USA SRI CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB UCITS ETF Acc EUR HEDGED

REPORTING

Communication  
Publicitaire

31/03/2024

ACTION ■

## Données clés (Source : Amundi)

Valeur Liquidative (VL) : **77,12 ( EUR )**  
Date de VL et d'actif géré : **28/03/2024**  
Actif géré : **3 929,51 ( millions EUR )**  
Code ISIN : **IE0000U24AJ9**  
Type de Réplication : **Physique**  
Indice de référence :  
**100% MSCI USA SRI FILTERED PAB 100%  
HEDGED TO EUR**

## Objectif d'investissement

Le Compartiment a pour objectif de répliquer la performance de l'Indice MSCI USA SRI Filtered PAB (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)



### Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
<b>Volatilité du portefeuille</b>	13,54%	17,95%	17,92%
<b>Volatilité de l'indice</b>	13,53%	18,10%	18,03%
<b>Tracking Error ex-post</b>	0,15%	0,40%	0,39%
<b>Ratio de sharpe</b>	1,11	0,28	0,71

\* 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 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 -	Depuis le 10/06/2020
<b>Portefeuille</b>	5,03%	1,79%	5,03%	18,65%	21,20%	-	54,49%
<b>Indice</b>	4,95%	1,76%	4,95%	18,34%	21,78%	-	55,11%
<b>Ecart</b>	0,09%	0,03%	0,09%	0,31%	-0,57%	-	-0,62%

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

	2023	2022	2021	2020	2019
<b>Portefeuille</b>	22,15%	-23,53%	30,03%	-	-
<b>Indice</b>	22,13%	-23,15%	30,34%	-	-
<b>Ecart</b>	0,02%	-0,38%	-0,31%	-	-

\* 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 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

Rencontrez l'équipe



**Lionel Brafman**  
Responsable Gestion Indicielle & Multistratégie



**Lionel Issom Nlep**  
Gérant de portefeuille principal



**Jerome Gueguen**  
Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

L'Indice est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI USA, représentatif des titres de grande et moyenne capitalisation du marché américain (l'« Indice parent »). L'Indice offre une exposition aux sociétés ayant des notations environnementales, sociales et de gouvernance (ESG) exceptionnelles 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 répondra les titres en fonction des opportunités et des risques associés à la transition climatique, afin de satisfaire aux exigences minimales du règlement de l'UE sur les indices de référence alignés sur l'Accord de Paris (« EU PAB »).

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Action**  
Exposition : **USA**

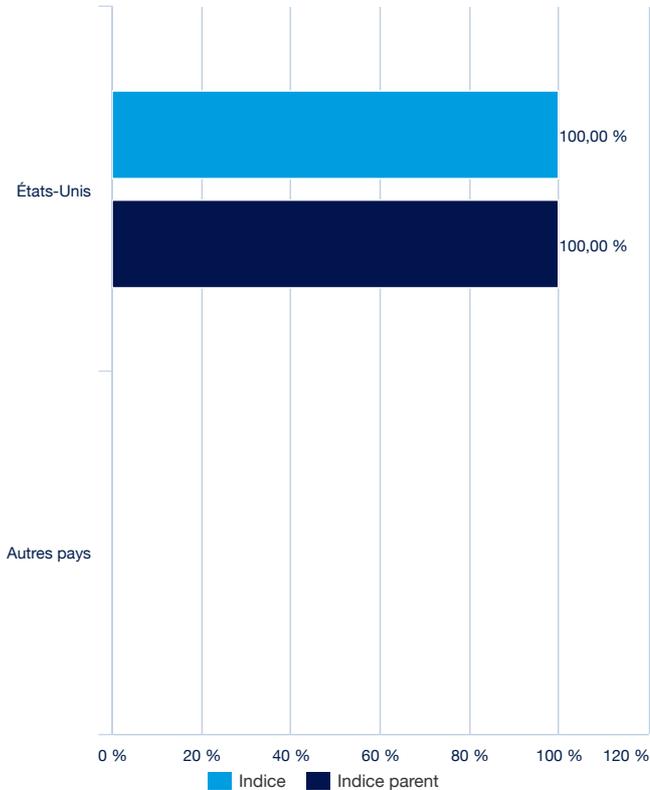
Nombre de valeurs : **125**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
MICROSOFT CORP	4,93%	6,45%
TESLA INC	4,26%	1,09%
HOME DEPOT INC	3,95%	0,83%
TEXAS INSTRUMENTS	2,70%	0,34%
DANAHER CORP	2,60%	0,38%
ADOBE INC	2,51%	0,50%
WALT DISNEY CO/THE	2,38%	0,49%
PROLOGIS INC	2,21%	0,26%
VERIZON COM. INC	2,03%	0,38%
INTUIT INC	1,89%	0,40%
<b>Total</b>	<b>29,45%</b>	<b>11,12%</b>

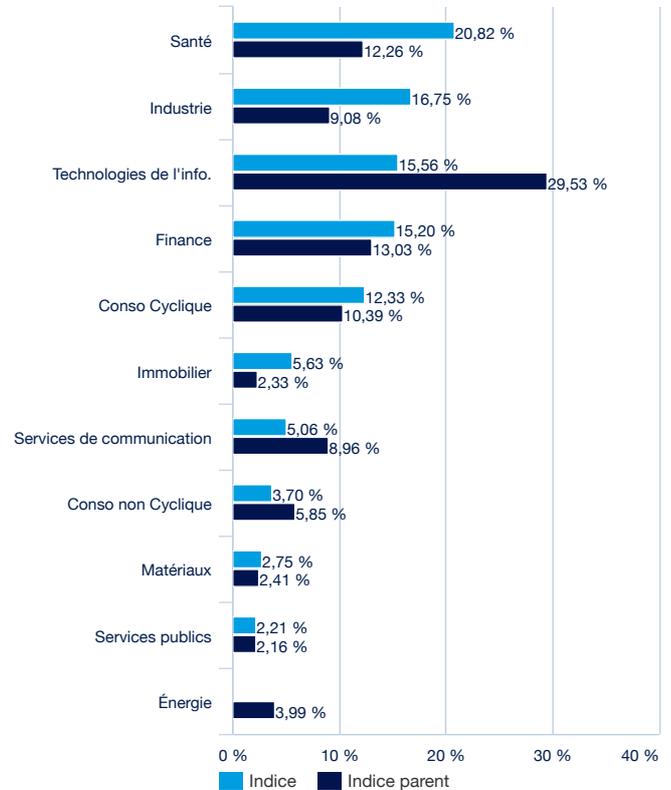
Indice parent : **MSCI USA**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **MSCI USA**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **MSCI USA**

ACTION ■

**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
<b>Note Globale</b>	7,92	6,65
<b>Environnement</b>	7,44	6,83
<b>Social</b>	5,60	5,12
<b>Gouvernance</b>	6,25	5,51

Indice parent : **MSCI USA**

**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	Indice parent
Total en tCO <sub>2</sub> / M€ (Indice/Indice parent) :	15,57	49,73

**Empreinte Carbone**

Cet indicateur mesure les émissions du portefeuille en tonnes de CO<sub>2</sub> équivalent par million d'euros investis.

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

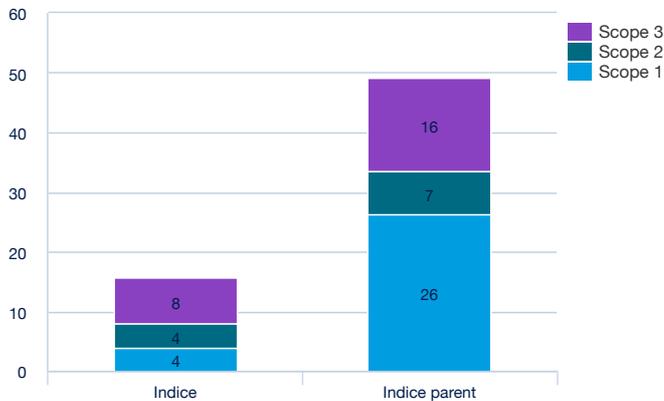
**Définition des scopes :**

- **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 carbonées sont fournies par Trucost. Elles correspondent aux émissions annuelles des entreprises et sont exprimées en tonnes équivalent CO<sub>2</sub>, 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 CO<sub>2</sub>.



Indice parent : **MSCI USA**

**Label ISR**



REPUBLIQUE FRANÇAISE

## ACTION ■

**Caractéristiques principales de la part (Source : Amundi)**

Forme juridique	ICAV de droit Irlandais
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Ireland Limited
Valorisateur	HSBC Securities Services (Ireland) DAC
Dépositaire	HSBC Continental Europe
Commissaire aux comptes	PRICEWATERHOUSECOOPERS
Date de création de la classe	09/11/2023
Date de la première VL	10/06/2020
Devise de référence de la classe	EUR
Classification AMF	-
Affectation des sommes distribuables	Capitalisation
Code ISIN	IE0000U24AJ9
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VL	Quotidienne
Frais courants	0,20% ( Estimés ) - 09/11/2023
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Clôture fiscale	Décembre
Teneur marché principal	

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

Place de cotation	Horaires de cotation	Devise	Mnémo	Ticker Bloomberg	iNAV Bloomberg	RIC Reuters	iNAV Reuters
Borsa Italiana	-	EUR	USRIH	USRIH IM	IUSRIHIV	USRIH.MI	IUSRIHINAV=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**

AMUNDI MSCI USA SRI CLIMATE NET ZERO AMBITION PAB UCITS ETF (LE « COMPARTIMENT ») N'EST PAS COMMANDITÉ, ENDOSSÉ, VENDU OU PROMU PAR MSCI INC. « MSCI ») OU PAR L'UNE DE SES FILIALES, L'UN DE SES FOURNISSEURS D'INFORMATION OU TOUT AUTRE TIERS IMPLIQUÉ DANS LA COMPILATION OU LA CRÉATION D'UN INDICE MSCI (COLLECTIVEMENT, LES « PARTIES MSCI ») OU LIÉ À CES DERNIÈRES ACTIONS. LES INDICES MSCI SONT LA PROPRIÉTÉ EXCLUSIVE DE MSCI ET SONT DES MARQUES DE SERVICE DE MSCI OU DE SES FILIALES. AMUNDI A OBTENU DES LICENCES D'UTILISATION DES INDICES MSCI À CERTAINES FINS. AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT DE DÉCLARATION NI NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, À L'ÉMETTEUR, AUX PROPRIÉTAIRES DE CE COMPARTIMENT OU À TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ CONCERNANT L'OPPORTUNITÉ D'INVESTIR DANS DES COMPARTIMENTS EN GÉNÉRAL OU DANS CE COMPARTIMENT EN PARTICULIER, NI QUANT À LA CAPACITÉ DE TOUT INDICE MSCI À RÉPLIQUER LA PERFORMANCE DU MARCHÉ DES ACTIONS CORRESPONDANT. MSCI ET SES FILIALES SONT LES CONCÉDANTES DE LICENCE DE CERTAINES MARQUES DÉPOSÉES, MARQUES DE SERVICE ET NOMS COMMERCIAUX, AINSI QUE DES INDICES MSCI DÉTERMINÉS, COMPOSÉS ET CALCULÉS PAR MSCI, SANS TENIR COMPTE D'AMUNDI, DE CE COMPARTIMENT OU DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT, NI DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ.

AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A L'OBLIGATION DE TENIR COMPTE DES BESOINS D'AMUNDI, DES PORTEURS DE PARTS DE CE COMPARTIMENT OU DE TOUTE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ LORS DE LA DÉTERMINATION, DE LA COMPOSITION OU DU CALCUL DES INDICES MSCI. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE OU N'A PARTICIPÉ À L'ÉTABLISSEMENT DU CALENDRIER, À LA FIXATION DES PRIX OU À LA DÉTERMINATION DES QUANTITÉS À ÉMETTRE POUR CE COMPARTIMENT, PAS PLUS QU'À LA DÉTERMINATION OU AU CALCUL DE L'ÉQUATION OU À LA RÉTRIBUTION CONTRE LAQUELLE CE COMPARTIMENT PEUT ÊTRE RACHETÉ. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI N'A LA MOINDRE OBLIGATION OU RESPONSABILITÉ VIS-À-VIS DE L'ÉMETTEUR OU DES PROPRIÉTAIRES DE CE COMPARTIMENT, NI VIS-À-VIS D'AUCUNE AUTRE PERSONNE OU ENTITÉ ASSOCIÉE À L'ADMINISTRATION, À LA COMMERCIALISATION OU 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 QU'ELLE ESTIME FIABLES, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE GARANTIT L'ORIGINALITÉ, LA PRÉCISION ET/OU L'EXHAUSTIVITÉ DES INDICES MSCI OU DE TOUTE DONNÉE INCLUSE. AUCUN CONCÉDANT NE DONNE DE GARANTIE, EXPRESSE OU IMPLICITE, QUANT AUX RÉSULTATS OBTENUS DÉCOULANT DE L'UTILISATION DE L'INDICE OU DES DONNÉES QUI EN FONT PARTIE PAR L'ÉMETTEUR DU COMPARTIMENT, SES PROPRIÉTAIRES OU TOUTE AUTRE PERSONNE. AUCUNE DES PARTIES MSCI N'EST RESPONSABLE DES ERREURS, DES OMISSIONS OU DES INTERRUPTIONS D'UN INDICE MSCI OU EN RAPPORT AVEC CELUI-CI OU DE TOUTE INFORMATION QUI Y EST INCLUSE. EN OUTRE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE FAIT, EXPRESSÉMENT OU IMPLICITEMENT, AUCUNE GARANTIE ET LES PARTIES MSCI DÉCLINENT EXPRESSÉMENT PAR LES PRÉSENTES TOUTES LES GARANTIES RELATIVES AUX INDICES MSCI ET À TOUTES LES DONNÉES QUI Y SONT INCLUSES QUANT À LEUR QUALITÉ MARCHANDE ET LEUR ADÉQUATION À UN USAGE PARTICULIER. SANS POUR AUTANT LIMITER LE CARACTÈRE GÉNÉRAL DE CE QUI PRÉCÈDE, AUCUNE DES PARTIES MSCI NE SERA EN AUCUN CAS TENUE RESPONSABLE DES DOMMAGES DIRECTS, INDIRECTS, PARTICULIERS, DE NATURE PUNITIVE OU CONSÉCUTIFS OU DE TOUT AUTRE PRÉJUDICE (Y COMPRIS LE MANQUE À GAGNER), MÊME SI ELLES SONT AVISÉES DE LA POSSIBILITÉ DE TELS DOMMAGES.

**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, CH-1260 Nyon, Suisse (anciennement « CACEIS Bank Luxembourg, Luxembourg, Succursale de Nyon ». 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 («DIC») 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 décline 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.