

Amundi MSCI EMU ESG Selection UCITS ETF EUR

REPORTING

Communication
Publicitaire

30/09/2026

ACTIONS ■

Objectif d'investissement

Ce Compartiment est géré passivement. L'objectif de ce Compartiment est de répliquer la performance de l'Indice MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped (l'« Indice ») 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. Le Compartiment promeut les caractéristiques environnementales et/ou sociales en répliquant, entre autres, un Indice intégrant une évaluation environnementale, sociale et de gouvernance (ESG). L'Indice MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped est un indice d'actions basé sur l'Indice MSCI EMU (l'« Indice parent »), représentatif des titres de grande et moyenne capitalisation de 10 pays développés (à compter de septembre 2020) au sein de l'Union économique et monétaire (UEM) et émis par des sociétés qui ont les notations ESG les plus élevées dans chaque secteur de l'Indice parent. La méthodologie de l'Indice repose sur une « approche Best-in-class » : les entreprises les mieux classées sont sélectionnées pour déterminer l'Indice. L'approche « best-in-class » est une approche où les investissements les plus performants ou leaders sont sélectionnés au sein d'un univers, d'un secteur industriel ou d'une catégorie. Il exclut les sociétés qui sont en retard sur le plan ESG, en particulier sur la base des notations ESG. En utilisant cette approche « best-in-class », l'Indice suit une approche extra-financière fortement engageante qui permet de réduire l'univers d'investissement initial d'au moins 20 % (exprimé en nombre d'émetteurs). Les enjeux ESG clés peuvent inclure, sans s'y limiter, le stress hydrique, les émissions de carbone, la gestion du personnel ou l'éthique commerciale. 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. 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.). Pour de plus amples informations concernant les exclusions appliquées par l'Indice conformément aux indices de référence de l'UE alignés sur l'Accord de Paris (ou PAB), veuillez consulter la section du Prospectus intitulée « Directives concernant les dénominations des fonds contenant des termes liés aux critères ESG ou à la durabilité ». De plus amples informations sur la composition de l'Indice et ses règles de fonctionnement sont disponibles dans le prospectus et à l'adresse : [msci.com](https://www.msci.com). La valeur de l'Indice est disponible via Bloomberg (MXEMUEL5). 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)



Indicateurs de risque (Source : Fund Admin)

	1 an	3 ans	Depuis le lancement *
Volatilité du portefeuille	14,91%	13,78%	17,89%
Volatilité de l'indice	14,88%	13,76%	17,88%
Tracking Error ex-post	0,12%	0,16%	0,16%
Ratio de sharpe	1,55	1,05	0,44

* 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 31/12/2025	1 mois 31/08/2026	3 mois 30/06/2026	1 an 30/09/2025	3 ans 29/09/2023	5 ans 30/09/2021	Depuis le 14/02/2018
Portefeuille	17,55%	-2,12%	-2,90%	23,29%	60,41%	64,61%	111,48%
Indice	17,37%	-2,12%	-2,89%	23,04%	58,92%	61,86%	105,38%
Ecart	0,18%	0,00%	-0,01%	0,25%	1,49%	2,75%	6,10%

Performances calendaires * (Source : Fund Admin)

	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Portefeuille	19,65%	6,49%	17,06%	-10,98%	21,31%	-1,38%	28,62%	-	-	-
Indice	19,16%	6,07%	16,69%	-11,35%	20,74%	-1,48%	28,17%	-	-	-
Ecart	0,48%	0,42%	0,38%	0,37%	0,57%	0,10%	0,46%	-	-	-

* 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 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.

Notation Morningstar ©

Notation Morningstar "Overall" © : 4 étoiles

Catégorie Morningstar © :

EEA FUND EUROZONE LARGE-CAP EQUITY

Date de notation : 31/08/2026

Nombre de fonds de la catégorie : 1213

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	C : 412,52 EUR D : 83,75 EUR
Actif géré	2338,07 (millions EUR)
Frais de gestion et autres coûts administratifs ou d'exploitation *	0,25%
Date de la VNI	30/09/2026
Code ISIN	C : LU1602144575 D : LU2059756325
Type de Réplication	Physique
Indice de référence	100% MSCI EMU ESG SELECTION P-SERIES 5% ISSUER CAPPED INDEX
Affectation des sommes distribuables	(C) Capitalisation (D) Distribution
Date du dernier coupon	09/12/2025 (EUR)
Dernier dividende	1,6500 (EUR)
Forme juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Norme européenne	OPCVM
Société de gestion	Amundi Luxembourg SA
Teneur marché principal	BNP Paribas
Valorisateur	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Dépositaire	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
Commissaire aux comptes	DELOITTE AUDIT
Date de création de la classe	20/04/2017
VL de lancement	195,06 (EUR)
Date de la première VL	14/02/2018
Devise de référence de la classe	EUR
Minimum de souscription marché secondaire	1 Part(s)
Périodicité de calcul de la VNI	Quotidienne
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans
Clôture fiscale	Septembre

* 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 & Multistratégie

**Vincent Masson**

Gérant de portefeuille senior - Index & Multistratégies

**Jerome Gueguen**

Gérant suppléant

Données de l'indice (Source : Amundi)

Description de l'indice

MSCI EMU ESG Selection P-Series 5% Issuer Capped est un indice d'actions basé sur l'indice MSCI EMU (l'« Indice cadre »), représentatif des titres de moyenne à grande capitalisation de 10 pays développés (en septembre 2020) de l'Union économique et monétaire européenne et émis par des sociétés assorties de notations exceptionnelles en matière environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) dans chaque secteur de l'Indice cadre.

Caractéristiques (Source : Amundi)

Classe d'actif : **Actions**
Exposition : **Zone Euro**

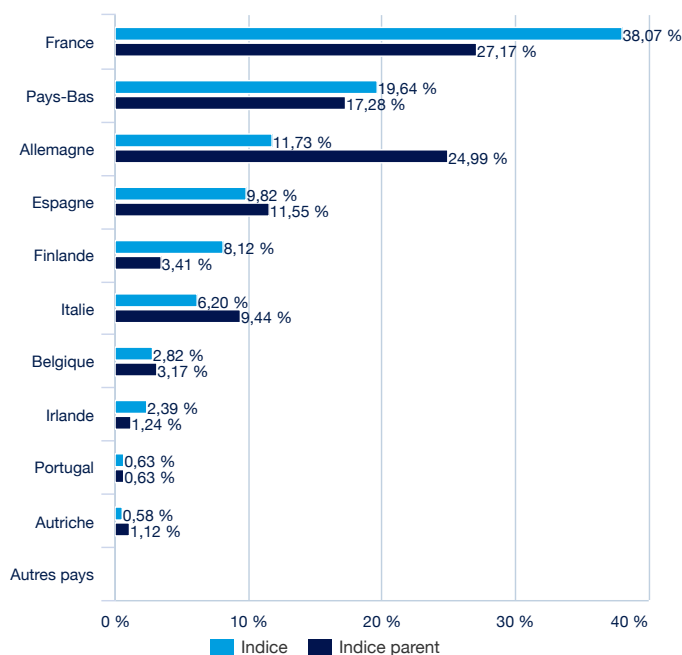
Nombre de valeurs : **98**

Principales lignes de l'indice (source : Amundi)

	% d'actifs (indice)	% d'actifs (Indice parent)
ASML HOLDING NV	9,39%	9,39%
NOKIA OYJ HELSINKI	5,23%	0,70%
SCHNEIDER ELECT SE	5,07%	2,46%
ALLIANZ SE-REG	4,86%	2,43%
DASSAULT SYSTEMES SE	4,72%	0,21%
IBERDROLA SA	4,20%	1,92%
AIR LIQUIDE SA	3,47%	1,59%
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,23%	1,48%
BNP PARIBAS	3,19%	1,46%
INTESA SANPAOLO	3,16%	1,44%
Total	46,52%	23,08%

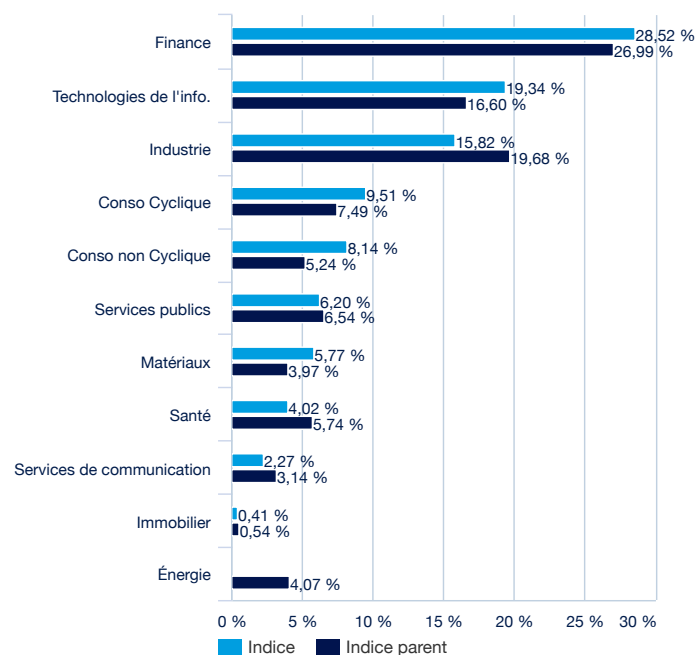
Indice parent : **MSCI EMU**

Répartition géographique de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **MSCI EMU**

Secteurs de l'indice (source : Amundi)



Indice parent : **MSCI EMU**

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	8,84	8,03
Environnement	7,02	6,71
Social	6,09	5,66
Gouvernance	6,95	6,61

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)

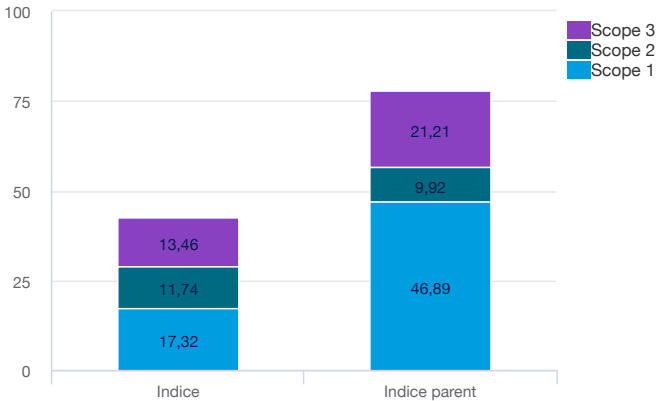
«G» pour Gouvernance (gouvernance d'entreprise et comportement d'entreprise)

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

Empreinte Carbone

Empreinte carbone par million d'euros investis

	Indice	Indice parent
Total en tCO2 / M€ (Indice/Indice parent) :	42,52	78,02



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 carbone 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	CMU SW	INCMU	CMU.S	INCMU=BNPP
Deutsche Boerse (Xetra)	EUR	AMED GY	INCMU	AMAMED.DE	INCMU=BNPP
Euronext Paris	EUR	CMU FP	INCMU	CMU.PA	INCMU=BNPP
LSE	GBP	CMU LN	-	CMU.L	-
Bolsa Mexicana de Valores	MXN	CMUN MM	-	-	-
Euronext Milan	EUR	CMU IM	INCMU	CMU.MI	INCMU=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